

Rapport annuel audité

Pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV

Société d'investissement à capital variable

À l'intention des investisseurs suisses

Aucune souscription ne peut être reçue sur la seule base du rapport financier. Les souscriptions sont valables uniquement sur la base du Prospectus en vigueur accompagné d'une copie du dernier Rapport annuel ainsi que d'une copie du dernier Rapport semestriel, s'il est publié après le Rapport annuel.

Numéro RCS B 141 816

Table des matières

	Page
Administrateurs et administration	1
Rapport du Conseil d'administration	2
Rapport des Gestionnaires financiers	8
Rapport d'audit	26
État consolidé des actifs nets	29
Compte de résultat consolidé	36
État consolidé des variations des actifs nets	44
Informations statistiques	52
Tableaux des investissements	
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	63
State Street EMU Government Bond Index Fund	66
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	73
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	74
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	114
State Street Global Treasury Bond Index Fund	141
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	180
State Street Japan Screened Index Equity Fund	335
State Street Switzerland Index Equity Fund	338
State Street UK Index Equity Fund	339
State Street US Screened Index Equity Fund	341
State Street EMU Screened Index Equity Fund	349
State Street Europe Screened Index Equity Fund	352
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	358
State Street World Screened Index Equity Fund	360
State Street World ESG Index Equity Fund	385
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	403
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	421
State Street Europe Value Spotlight Fund	428
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	429
State Street US Value Spotlight Fund	430
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund	431
State Street Global Value Spotlight Fund	432
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	434
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	438
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	442
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	445
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	451
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	459
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	468
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	470
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	473
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	479

Table des matières *(suite)*

	Page
Tableaux des investissements <i>(suite)</i>	
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	483
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	485
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	517
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	525
State Street Global Opportunities Equity Fund	527
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	528
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	557
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	581
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	634
State Street US Opportunities Equity Fund	641
State Street China Opportunities Equity Fund	642
State Street Sustainable Climate World Equity Fund	643
State Street Sustainable Climate US Equity Fund	651
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	654
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	669
Notes aux États financiers	674
Annexe I – Informations relatives à la divulgation des risques (non auditées)	712
Annexe II – Écart de suivi indiciel (non audité)	713
Annexe III - Note pour les investisseurs en Suisse (non auditée)	716
Annexe IV – Opérations de financement sur titres (non auditées)	728
Annexe V – Politique de rémunération (non auditée)	764
Annexe VI – Informations à fournir en vertu du SFDR et du Règlement Taxinomie	766

Le prospectus, les informations clés pour l'investisseur, les statuts, les rapports annuels et semestriels de STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV, ainsi que la liste des achats et ventes effectués par STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV pendant la période peuvent être obtenus sur simple demande et gratuitement au siège du Représentant et Service de paiement en Suisse, State Street Bank International GmbH, Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, Postfach, CH-8027 Zurich.

Administrateurs et administration

CONSEIL D'ADMINISTRATION DE LA SICAV

Eric Linnane, Président, Directeur général, State Street Global Advisors Europe Limited
Jean-François Klein, Vice-président, State Street Global Advisors Limited
Tracey McDermott, Administratrice indépendante non exécutive
John Li How Cheong, Administrateur indépendant non exécutif
Vanessa Donegan, Administratrice indépendante non exécutive

LA SICAV

State Street Global Advisors Luxembourg SICAV
49, Avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Luxembourg

SOCIÉTÉ DE GESTION

State Street Global Advisors Europe Limited
78 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irlande

GESTIONNAIRE FINANCIER

State Street Global Advisors Europe Limited
78 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irlande

GESTIONNAIRES FINANCIERS DÉLÉGUÉS

State Street Global Advisors Limited
20 Churchill Place
Canary Wharf
London E14 5HJ
Royaume-Uni

State Street Global Advisors Trust Company
Channel Center
One Congress Street
Boston
Massachusetts 02114
États-Unis

State Street Global Advisors Singapore Ltd
168 Robinson Road
#33-01 Capital Tower
Singapore 068912

DISTRIBUTEUR MONDIAL

State Street Global Advisors Europe Limited
78 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irlande

RÉVISEUR D'ENTREPRISE AGRÉÉ

PricewaterhouseCoopers, Société
coopérative 2, rue Gerhard Mercator
L-2182 Luxembourg
Luxembourg

ADMINISTRATION CENTRALE, DÉPOSITAIRE, AGENT PAYEUR PRINCIPAL, AGENT DE TRANSFERT ET DOMICILIATAIRE

State Street Bank International GmbH,
Succursale de Luxembourg
49, Avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Luxembourg

AGENTS DE PRÊT DE TITRES

State Street Bank and Trust Company
Copley Place
100, Huntington Avenue
Boston
Massachusetts 02116
États-Unis

State Street Bank International GmbH,
London Branch
20 Churchill Place
Canary Wharf
London E14 5HJ
Royaume-Uni

CONSEILLER JURIDIQUE

Arendt & Medernach SA
41A, Avenue J.F. Kennedy
L-2082 Luxembourg
Luxembourg

REPRESENTANT EN SUISSE

State Street Bank International GmbH
München
Zweigniederlassung Zürich
Beethovenstrasse 19
Postfach
8027 Zurich

SERVICE DE PAIEMENT EN SUISSE

State Street Bank International GmbH
München
Zweigniederlassung Zürich
Beethovenstrasse 19
Postfach
8027 Zurich

Rapport du Conseil d'administration

Chers Actionnaires,

Le Conseil d'administration (le « Conseil d'administration ») du Fonds à compartiments multiples State Street Global Advisors Luxembourg SICAV (la « SICAV ») a le plaisir de vous présenter le Rapport annuel audité pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 ainsi que les principaux développements survenus au cours du dernier exercice financier.

Compartiments proposés

La SICAV offre un large éventail de stratégies d'investissement coordonnées conformes à la Directive OPCVM et se composait au 31 décembre 2023 de quarante-huit (48) Compartiments (chacun un « Compartiment », ensemble les « Compartiments »), dont quarante-huit (48) étaient financés. À titre de comparaison, au 31 décembre 2022, la SICAV comprenait cinquante (50) Compartiments, dont quarante-huit (48) étaient financés.

La SICAV propose une série de fonds qui offrent, via des stratégies de gestion active ou indicielle, une exposition à différentes catégories d'actifs, dont les actions et les titres à revenu fixe. Les investisseurs peuvent accéder aux investissements sur les marchés développés et émergents, ainsi qu'aux stratégies spécialisées telles que la volatilité gérée et l'allocation d'actifs. La SICAV propose également une gamme de fonds en actions et titres à revenu fixe assortis de caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (« ESG »).

Actifs sous gestion

Au 31 décembre 2023, le total des actifs nets de la SICAV s'élevait à 31,84 milliards d'EUR, contre 25,40 milliards d'EUR au 31 décembre 2022.

Performance

Les rendements totaux par Compartiment ainsi que les données de référence comparatives pour la période considérée sont fournis dans le Rapport des Gestionnaires financiers, aux pages 8 à 25. Ces chiffres sont historiques et ne sont pas nécessairement indicatifs des performances futures.

Commissions et frais

Les Commissions de gestion actuelles, les Totaux des frais sur encours (TER) et les plafonds du Total des frais sur encours (plafond TER) des Compartiments sont listés à la Note 3B, aux pages 680 à 689.

Lancements et clôtures de Compartiments

Un (1) nouveau Compartiment a été lancé au cours de l'exercice financier :

Nom du Compartiment	Date de lancement
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	Décembre 2023

Un (1) Compartiment a été liquidé au cours de l'exercice financier :

Nom du Compartiment	Date de liquidation
State Street Canada Index Equity Fund	Juin 2023

Le Conseil continue d'apporter des changements à la gamme des Compartiments lorsque cela s'avère au mieux des intérêts des investisseurs.

Modifications des commissions

Au cours de la période sous revue, aucune modification n'a été apportée aux commissions.

Retrait du Compartiment

Le 30 juin 2023, le Compartiment State Street China Treasury and Policy Bank Bond Index Fund a été retiré du Prospectus.

Investissements ESG

La gamme de Compartiments en actions et titres à revenu fixe assortis de caractéristiques ESG offerte par la SICAV s'est étoffée au courant de cet exercice financier, tant en termes de nombre de Compartiments proposés que de valeur nette d'inventaire totale.

La SICAV est composée de quarante-huit (48) Compartiments, dont vingt-huit (28) ont été classés comme produits financiers relevant de l'article 8 du SFDR. L'actif net total de ces vingt-huit (28) Compartiments représente 17,06 milliards d'EUR ou 53,6 % de l'actif net total de la SICAV au 31 décembre 2023. À titre de comparaison, au 31 décembre 2022, la SICAV comprenait vingt-huit (28) compartiments classés comme produits financiers relevant de l'article 8 du SFDR. L'actif net total de ces vingt-huit (28) Compartiments représentait 13,06 milliards d'EUR ou 51,3 % de l'actif net total de la SICAV à la même date.

Rapport du Conseil d'administration (*suite*)

Autres modifications

Comme communiqué aux Actionnaires en date du 30 juin 2023, nous avons actualisé les Annexes SFDR des Compartiments listés ci-dessous afin de refléter leur engagement minimum en matière d'investissement durable :

State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund (Annexe 18);

State Street Sustainable Climate US Equity Fund (Annexe 25);

State Street Sustainable Climate World Equity Fund (Annexe 26);

State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund (Annexe 27);

State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund (Annexe 28).

Rapport du Conseil d'administration (suite)

Dividendes

Le 20 avril 2023, le Conseil a distribué des dividendes (par action) au titre des Compartiments suivants :

Nom du Compartiment	Nom de la Catégorie	Dividendes distribués
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (USD)	0,39 USD
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	0,22 EUR
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	0,29 EUR
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	0,02 EUR
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	0,01 EUR
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	0,09 EUR
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	0,11 EUR
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	0,09 EUR
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie A2 Distribution (EUR)	0,09 EUR
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	0,35 EUR
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	0,34 EUR
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I Distribution (USD)	0,23 USD
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	0,24 EUR
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,08 USD
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	GBP0.07
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,07 EUR
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,10 GBP
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,09 EUR
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,03 EUR
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,13 USD
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en CHF)	0,12 CHF
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,13 GBP
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie S Distribution (EUR)	0,20 EUR
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,48 GBP
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	0,05 EUR

Enregistrement

La SICAV est un véhicule conforme aux normes OPCVM et peut être proposée à la vente, sous réserve toutefois d'être enregistrée dans des pays autres que le Luxembourg, son pays d'origine. Au cours de l'exercice, certains Compartiments et certaines catégories d'actions ont également été enregistrés pour être distribués en Allemagne, en Autriche, en Belgique, au Danemark, en Espagne, aux États arabes unis, en Finlande, en France, en Irlande, en Islande, en Italie, aux Pays-Bas, à Singapour, en Suède, en Suisse et au Royaume-Uni.

Rapport du Conseil d'administration (*suite*)

Gouvernance d'entreprise et Code de déontologie de l'ALFI

Le Conseil d'administration est chargé de garantir une gouvernance d'entreprise de haut niveau et considère que la SICAV s'est conformée aux meilleures pratiques de l'industrie des fonds luxembourgeois. Le Conseil d'administration a notamment adopté le Code de déontologie de l'ALFI (le « Code ») qui définit les principes de bonne gouvernance applicables aux fonds luxembourgeois.

Réviseur d'entreprise agréé indépendant

Le Réviseur d'entreprise agréé, PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, a indiqué être prêt à continuer son mandat et le Conseil d'administration a donné son accord pour continuer à proposer PWC comme réviseur d'entreprise agréé aux Actionnaires pour le prochain exercice.

Assemblée générale annuelle

L'Assemblée générale annuelle des actionnaires doit se tenir au Luxembourg le quatrième jeudi du mois d'avril, à 11 h, conformément aux Statuts.

La prochaine Assemblée générale annuelle de la SICAV se tiendra le 25 avril 2024.

Rapports périodiques

Les comptes annuels sont disponibles dans les quatre mois suivant la date de clôture de l'exercice financier. Les prochains comptes semestriels seront publiés dans les deux mois suivant la fin du semestre.

Nous souhaitons également rappeler à l'ensemble des Actionnaires et aux Actionnaires potentiels qu'aucune souscription ne peut être reçue sur la seule base du présent rapport financier. Les souscriptions sont valables uniquement sur la base du Prospectus actuel et du Document d'information clé pour l'investisseur, complétés du dernier rapport annuel et des rapports semestriels si ceux-ci ont été publiés ultérieurement.

Initiation et formation

Tous les nouveaux Administrateurs bénéficieront d'une initiation incluant les informations pertinentes concernant la SICAV et les devoirs et responsabilités attachés à leur fonction. En outre, le Conseil d'administration prend des mesures concrètes pour rester informé des évolutions pertinentes pour la SICAV et a veillé à ce qu'un programme de formation formelle soit déployé.

Évaluation par le Conseil d'administration

Le Conseil d'administration procède à une évaluation annuelle de sa performance.

Réunions et comités du Conseil d'administration

Le Conseil d'administration se réunit trimestriellement mais, si nécessaire, des réunions supplémentaires peuvent être planifiées. Compte tenu de la nature de l'activité de la SICAV, le Conseil d'administration ne juge actuellement pas nécessaire d'introduire un Comité d'audit ou un Comité de rémunération officiel. Lorsque des questions spécifiques requièrent un examen plus approfondi, des sessions de Discussion des informations supplémentaires ou des réunions *ad hoc* du Conseil d'administration sont organisées.

Cinq réunions du Conseil d'administration se sont tenues durant l'exercice financier, dont quatre ont pris la forme de réunions trimestrielles du Conseil.

En complément de la session ordinaire du Conseil d'administration durant laquelle le Réviseur d'entreprise agréé présente les conclusions de l'audit des comptes de la SICAV, les Administrateurs non exécutifs rencontrent également ce dernier à raison d'une fois par an sans la présence des Administrateurs occupant une fonction exécutive.

D'autres réunions et discussions d'information ont lieu en dehors du champ des réunions formelles du Conseil d'administration si nécessaire.

Rémunération du Conseil d'administration

Les Administrateurs indépendants non exécutifs bénéficient actuellement d'une rémunération de 45 000 EUR par an, tandis que les Administrateurs rattachés par ailleurs également employés par State Street Global Advisors ne perçoivent pour leur part aucune rémunération en leur qualité de membres du conseil.

Changements significatifs survenus après la clôture de l'exercice

Le Prospectus daté du 14 février 2024 est entré en vigueur.

Rapport du Conseil d'administration (*suite*)

Le Conseil d'administration

Eric Linnane (Président)

Administrateur rattaché. Membre du Conseil d'administration depuis le 22 avril 2021.

Eric Linnane bénéficie de plus de 35 ans d'expérience dans l'industrie des services financiers. Il occupe actuellement une fonction de directeur général chez State Street Global Advisors Europe Limited en qualité de Responsable des opérations d'investissement et de l'externalisation des activités. Eric a rejoint SSGA Ireland en 1997 comme spécialiste des opérations et a dirigé plusieurs équipes différentes au sein des départements Middle office et Gestion des relations avant d'accéder à sa position actuelle. Auparavant, il a occupé plusieurs postes au sein des divisions Trésor et banques de détail de Bank of Ireland Group. Eric a acquis une expérience approfondie au cours de ses plus de 30 années passées au sein du secteur, notamment dans la supervision de l'externalisation, la construction et la conformité des portefeuilles, la gestion des opérations de trading, le back office, la gestion des relations et le reporting de performance. Eric est titulaire d'un diplôme en commerce de l'University College Dublin et accrédité comme administrateur de fonds d'investissement certifié par l'Institute of Banking en Irlande. Il possède plus de 10 années d'expérience comme administrateur de sociétés d'investissement au sens de la MiFID et de sociétés de fonds de placement.

John Li How Cheong

Administrateur indépendant non exécutif. Membre du Conseil d'administration depuis le 14 mai 2012.

John Li est associé de The Directors' Office, le principal cabinet d'administrateurs indépendants au Luxembourg, depuis novembre 2011. John a poursuivi sa formation et obtenu son diplôme d'expert-comptable au Royaume-Uni. Il s'est installé au Luxembourg en 1987. Au cours des 34 dernières années, John a essentiellement travaillé dans le secteur financier, occupant des fonctions d'audit et de conseil auprès d'une clientèle constituée de banques, fonds d'investissement, compagnies d'assurances, etc. Ses clients, situés en Europe, aux États-Unis, au Japon et en Asie, lui ont permis d'acquérir une grande expérience des relations avec les sociétés internationales. John Li a été associé de KPMG Luxembourg pendant plus de 20 ans, période durant laquelle il y a été associé gérant pendant 8 ans (2000-2008) avant de devenir Président du conseil de surveillance pendant 3 ans (2008-2011). Il était également membre de l'équipe *Leadership du Global Investment Management Practice* chez KPMG.

Tracey McDermott

Administrateur indépendant non exécutif. Membre du Conseil d'administration depuis le 22 juin 2015.

Mme McDermott compte plus de 20 ans d'expérience dans le secteur des fonds d'investissement. Elle est spécialisée en gouvernance de fonds et agit en qualité d'administratrice indépendante de fonds luxembourgeois réglementés et non réglementés. Elle cumule également une expérience en matière d'OPCVM et de fonds d'investissement alternatifs. Elle possède une connaissance approfondie de la réglementation et travaille en étroite collaboration avec les acteurs clés du marché. Mme McDermott est un membre actif de l'ILA (l'Institut luxembourgeois des administrateurs) et participe aux initiatives du secteur.

Vanessa Donegan

Administrateur indépendant non exécutif. Membre du Conseil d'administration depuis le 24 janvier 2020.

Vanessa Donegan compte 37 ans d'expérience en gestion d'investissement. Elle a été responsable du bureau Asie-Pacifique chez Threadneedle Investments (devenue par la suite Columbia Threadneedle Investments) pendant vingt et un ans avant de prendre sa retraite fin 2018. Vanessa possède une vaste expérience du marketing auprès des clients institutionnels et de détail dans le monde entier. Elle a également acquis une expérience de l'allocation d'actifs grâce à sa fonction de fiduciaire d'une organisation caritative au cours des trente dernières années. Vanessa est actuellement administratrice non exécutive de Herald Investment Management Ltd et de JPMorgan Indian Investment Trust. Elle est administratrice non exécutive indépendante senior d'Invesco Asia Trust plc et de Fidelity China Special Situations Trust plc. Elle est titulaire d'un diplôme en lettres classiques de l'Université d'Oxford.

Rapport du Conseil d'administration (*suite*)

Jean-François Klein

Administrateur rattaché. Membre du Conseil d'administration depuis le 23 novembre 2022.

Jean-François Klein bénéficie de plus de 25 ans d'expérience dans l'industrie des services financiers. Il est Gestionnaire de produit chez State Street Global Advisors qu'il a rejoint en octobre 2014. Pendant les 25 dernières années, Jean-François a essentiellement travaillé en tant que gestionnaire des risques dans le secteur financier. Il a débuté sa carrière en France dans la division Banque d'investissement de NATIXIS, avant de déménager à Londres en 2001. Il a rejoint la division Investissements alternatifs de NATIXIS en novembre 2005 avec la responsabilité de créer des fonds d'investissement au Luxembourg principalement. En 2012, il a rejoint Royal London Asset Management en qualité de gestionnaire des risques de la division Patrimoines privés. Jean-François est titulaire d'un master en finance internationale de l'école de commerce française H.E.C. et est accrédité en tant qu'administrateur de fonds d'investissement certifié par l'Institute of Banking en Irlande.

Merci d'investir avec nous.

LE CONSEIL D'ADMINISTRATION

Rapport des Gestionnaires financiers

Pour la période de douze mois clôturée le 31 décembre 2023

Une grande partie des principales bourses mondiales ont terminé l'année 2023 sur une bonne note, le dernier trimestre garantissant des rendements à deux chiffres à de nombreux marchés cette année. L'année 2023 n'a pas été de tout repos pour les marchés, même si les poussées de volatilité et les corrections ont généralement été rapidement suivies de rebonds. L'optimisme a régné au début de l'année, les attentes des investisseurs concernant les baisses de taux étant renforcées par la fin des restrictions imposées depuis longtemps en Chine contre la pandémie. Ces espoirs d'assouplissement se sont avérés prématurés, car les relèvements ont continué pendant la majeure partie de l'année. En outre, la reprise tant attendue de l'économie chinoise a manqué de souffle compte tenu des préoccupations croissantes entourant le secteur immobilier. Les actions mondiales ont tout de même progressé, surmontant une correction provoquée par le secteur bancaire en mars, des communications peu enthousiastes en provenance des banques centrales et un regain de tension au Moyen-Orient après la riposte militaire israélienne à l'attaque du Hamas. Le repli constant, quoique parfois lent, de l'inflation a alimenté la confiance des investisseurs tandis que la résilience des données économiques a elle aussi nourri l'espoir d'un atterrissage en douceur. Les deux derniers mois de 2023 ont été solides pour les actions comme pour les obligations grâce à des chiffres meilleurs que prévu pour la hausse des prix et à un changement de pied clair des banques centrales, qui se sont faites plus accommodantes. L'évolution des bons du Trésor américain à 10 ans reflète l'ampleur des fluctuations des cours des obligations : en octobre, ils affichaient un rendement de 5 %, une première depuis 2007. Ensuite, ils ont terminé le mois de décembre à 3,88 %. Sur l'année 2023, l'indice FTSE All World Developed Index a enregistré un rendement de 23,7 % (+20,0 % en EUR).

États-Unis

Les actions américaines, telles que les mesure l'indice FTSE United States Index, ont augmenté de 27,1 % (+22,8 % en EUR), sur fond d'optimisme suscité par les progrès technologiques et de tendances désinflationnistes compensant les freins liés à une Réserve fédérale (Fed) au discours plutôt dur. Cela dit, alors que l'inflation se repliait à 3 % en juin (elle s'est ensuite inscrite à 3,1 % fin novembre), la Fed n'a pas modifié ses taux depuis juillet et les signes annonçant davantage de souplesse ont soutenu la montée des marchés en fin d'année. L'indice S&P 500 a clôturé 2023 sur un niveau record et l'indice Nasdaq, très axé sur les technologies, a quant à lui enregistré plus de 40 % de hausse. Les technologies, les communications et les biens de consommation discrétionnaire ont été les meilleurs élèves tandis que des secteurs plus « défensifs », tels que les services publics, les biens de consommation de base et la santé, sont restés en retrait. L'énergie n'a guère brillé ; le cours du pétrole brut Brent a enregistré un recul de 10 % sur l'année, une période en dents de scie où il a oscillé entre 70 et 100 USD le baril. Selon Factset Business Data & Analytics, au troisième trimestre, les sociétés du S&P 500 ont enregistré une augmentation de 4,9 % de leurs bénéfices en glissement annuel, après deux trimestres de recul. On attend toutefois une progression plus limitée des bénéfices au dernier trimestre 2023.

Europe

Malgré la guerre en Ukraine et des chiffres de croissance économique moroses, les actions européennes ont pris part au rebond de l'ensemble de la classe d'actifs. L'inflation était sur toutes les lèvres et face à son lent recul, la Banque centrale européenne (la « BCE ») a poursuivi sa trajectoire de resserrement en relevant son taux de dépôt de 2,0 % à 4,0 % en 2023. Malgré tout, la BCE a augmenté les taux pour la dernière fois en septembre et des progrès supérieurs aux attentes sur le front de l'inflation pendant les derniers mois de l'année, ainsi que des données économiques faibles dans l'ensemble, ont alimenté l'idée que la Banque centrale pourrait réduire ses taux dès le mois de mars 2024. L'inflation globale a chuté à 2,4 % en novembre. L'économie de la zone euro a enregistré une croissance à peine positive en 2023, avec une contraction du PIB de -0,1 % au troisième trimestre, après une progression de 0,2 % au deuxième trimestre et une croissance nulle sur les trois premiers mois de l'année. L'indice FTSE All World Developed Europe ex UK Index a enregistré un recul de 24,4 % (+20,4 % en EUR). Parmi les marchés individuels, l'indice DAX allemand a augmenté de 20 %, contre plus de 30 % pour l'indice FTSE MIB italien et environ 17 % pour le CAC-40 français.

Royaume-Uni

L'indice FTSE United Kingdom Index a engrangé 9,0 % en 2023 (+11,6 % en EUR), en retrait par rapport à bon nombre de ses homologues des marchés développés, alors que la Banque d'Angleterre (la « BoE ») a relevé les taux d'intérêt à cinq reprises (de 3,5 % à 5,25 %). L'économie britannique a eu des difficultés à progresser ; de fait, après un deuxième trimestre de stagnation, la croissance nulle estimée initialement pour le troisième trimestre a été révisée à la baisse à -0,1 %. La hausse des prix a accordé un peu de répit aux investisseurs, avec un recul de l'inflation globale annuelle à 3,9 % en novembre, alors qu'elle avait atteint en février son maximum de l'année 2023, à savoir, 10,4 %. Face à cette amélioration, les spéculations sont allées bon train sur le marché concernant une baisse des taux de la part d'une BoE en 2024, alors que l'institution ne les avait plus relevés depuis le mois d'août. Par ailleurs, malgré une hausse du chômage à 3,7 % au début de l'année, celui-ci est resté stable à 4,2 % sur la période juin-octobre.

Asie-Pacifique

En Asie, l'indice FTSE Japan Index a enregistré une performance de 28,3 % (+16,0 % en EUR) sur 12 mois. En dépit d'un clair assouplissement de sa politique de contrôle de la courbe des rendements, la Banque du Japon (la « BoJ ») a maintenu son taux d'intérêt directeur en territoire négatif, ce qui a profité à l'activité économique et fait grimper l'inflation. La BoJ a indiqué qu'elle mettrait fin aux taux négatifs lorsque son objectif d'inflation de 2 % serait atteint de façon « durable ». Toujours faible, le yen a soutenu un marché boursier nippon très axé sur les exportations, ce qui lui a permis d'effacer un record vieux de 33 ans en 2023. L'économie s'est malgré tout contractée plus que prévu au troisième trimestre, le PIB reculant à un rythme annualisé de -2,9 %, après avoir enregistré des croissances respectives aux premier et deuxième trimestres de 5 % et 3,6 %.

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Asie-Pacifique (suite)

L'indice FTSE All-World Developed Asia Pacific ex Japan Index s'est inscrit en hausse de 11,3 % (+7,5 % en EUR) sur la période, la majeure partie des gains ayant été obtenus au dernier trimestre. Le rebond post-pandémie attendu en Chine ne s'est pas concrétisé et les préoccupations concernant l'ampleur des pertes dans le secteur de l'immobilier ont lourdement pesé sur la confiance. À Hong Kong, l'indice Hang Seng a nettement sous-performé, avec un recul d'environ -10 % en 2023. Le reste de la région s'est cependant mieux comporté. En Corée du Sud, l'indice Kospi a progressé de près de 20 % grâce à une forte demande qui a profité à son secteur technologique. En Australie, l'indice S&P/ASX 200 a terminé une année mitigée sur une note positive avec un rendement d'environ 8 %.

Marchés émergents

Dans l'ensemble, les actions des marchés émergents (« ME ») ont sous-performé face à leurs homologues développés, un résultat principalement dû à la montée continue des taux d'intérêt américains et à la solidité que cette hausse a conférée au dollar américain. Néanmoins, la performance globale était positive : l'indice MSCI Emerging Markets Index a gagné 9,9 % sur l'année (+6,1 % en EUR) malgré des rendements mitigés à travers l'univers des ME. L'économie chinoise a déçu en raison des déboires de son secteur immobilier et d'une réponse budgétaire moins forte qu'espéré, alors que les tensions sino-américaines persistantes freinaient elles aussi les rendements. D'autres marchés émergents asiatiques, tels que la Thaïlande et la Malaise, ont également été à la peine. À l'inverse, Taiwan et la Corée ont affiché de solides gains. La faiblesse des cours du pétrole a nui aux progrès des ME au Moyen-Orient. Les ME d'Europe et d'Amérique ont enregistré de solides performances sur l'année.

Revenu fixe

Les marchés obligataires ont ouvert 2023 sur une note positive, les rendements profitant de l'espoir que les banques centrales tournent le dos aux relèvements des taux plus tard dans l'année. Pourtant, les rendements ont finalement augmenté au deuxième trimestre, face à une inflation obstinément élevée, qui a forcé les banques centrales à poursuivre le resserrement plus longtemps que prévu. Au cours des deux derniers mois de l'année, les obligations mondiales ont affiché de solides rendements alors que le ralentissement économique soutenait l'idée selon laquelle les grandes banques centrales décideraient prochainement d'une baisse des taux. Alors qu'il avait commencé la période à 3,87 %, le rendement des bons du Trésor américain à 10 ans a brièvement atteint 5 % en octobre avant de retrouver le niveau de 3,88 % à la fin du mois de décembre. Aux États-Unis, l'inversion de la courbe des rendements sur la partie de 2 à 10 ans s'est prolongée, même si l'écart s'est resserré : les rendements à 2 ans ont clôturé la période considérée à 4,25 %. La BoE a relevé les taux de 3,5 % à 5,25 % en août, puis n'y a plus touché. Sur l'année, les rendements des Gilts britanniques à 10 ans ont reculé de 3,67 % à 3,54 % alors qu'ils s'affichaient encore au-delà de 4,5 % en octobre.

Grâce au rebond qu'elles ont enregistré en novembre et en décembre, les obligations de la zone euro ont plus que compensé la forte augmentation des rendements signée en septembre et en octobre. La BCE a lancé une série de relèvements qui a fait grimper le taux de dépôt de 200 pb, soit à 4,0 %. Un nombre croissant d'analystes estiment en outre que la hausse du mois de septembre sera probablement la dernière de ce cycle. Même si l'inflation est lentement redescendue des sommets qu'elle avait atteints, la BCE avait réaffirmé que les taux augmenteraient autant que nécessaire en dépit des craintes de récession. Les rendements des obligations allemandes à 10 ans ont terminé l'année 2023 à 2,02 %, contre 2,57 % 12 mois plus tôt. Les rendements des obligations italiennes à 10 ans ont terminé la période considérée à 3,7 %, contre 4,72 % 12 mois plus tôt.

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Perspectives

En 2023, les économies mondiales ont fait preuve d'une résilience étonnante alors que nous assistions au cycle de resserrement le plus marqué depuis des décennies. Malgré cette solidité à l'échelle mondiale, et notamment aux États-Unis, la croissance perd tout de même de la vitesse. Les volumes d'échanges se réduisent dans le monde et la production industrielle est pratiquement à l'étalement en glissement annuel. Les services ont fait beaucoup mieux, la demande réprimée pendant la pandémie ayant été satisfaite avec un certain retard, mais on observe tout de même des signes de tassement.

Il est temps pour les banques centrales de mettre fin au cycle de resserrement. Aux États-Unis, où le processus de désinflation est plus avancé et où il est clair que l'inflation liée au logement va se modérer, la Réserve fédérale devrait, selon nous, abaisser les taux d'au moins 100 pb si elle ne veut pas risquer que l'atterrissage en douceur prenne une tournure plus dramatique. La volatilité au niveau géopolitique est également un facteur à prendre en compte dans les perspectives, compte tenu des nombreuses élections prévues sur toute la planète et de la menace que des conflits nouveaux ou existants dégénèrent et provoquent plus de dégâts.

En raison des possibilités de recul marqué de l'activité économique, nous estimons que la dette souveraine, et en particulier les bons du Trésor américain, constitue une proposition attrayante à moyen terme pour les investisseurs, même après les fortes progressions enregistrées à la fin de 2023. Face aux niveaux de rendement actuels, au ralentissement de la croissance, à la poursuite de la désinflation et à l'assouplissement probable des politiques des banques centrales, nous considérons que le revenu fixe est l'une des catégories d'actifs les mieux positionnées en 2024 sur le plan du rapport risque/récompense. L'affaiblissement de l'économie et la progression du cycle de crédit pèseront sur les bénéfices et les bilans des entreprises. Nous estimons donc que les investisseurs en crédit devraient voir apparaître des niveaux d'entrée plus rentables au cours de l'année. Les marchés émergents restent vulnérables, mais recèlent tout de même quelques opportunités ponctuelles. Nous privilégions pour le moment la dette en devise forte plutôt que les titres en devise locale compte tenu des taux aux États-Unis.

Après les solides performances enregistrées en 2023, les actions ont démarré l'année 2024 sur les chapeaux de roue. Cela dit, la volatilité accrue et la fragilité à l'échelle mondiale pourraient les freiner au cours de l'année. Nous préférons sélectionner des composantes du marché qui présentent les caractéristiques d'un investissement de qualité. Le marché américain a notre préférence, compte tenu de sa composition sectorielle et de l'avantage concurrentiel de ses sociétés. Au niveau sectoriel, les technologies de l'information, l'industrie et les matériaux sont les principaux bénéficiaires des lois récemment adoptées aux États-Unis concernant le soutien budgétaire aux investissements dans les technologies propres et les nouvelles infrastructures (telles que la loi sur la réduction de l'inflation, la loi bipartite pour les infrastructures et la loi CHIPS sur les semi-conducteurs). Les sociétés internationales présentes aux États-Unis ainsi que les sociétés américaines peuvent également prétendre à ces aides. Différentes raisons structurelles nous poussent à considérer que le Japon devrait conserver sa dynamique de performance positive. Pourtant, les investisseurs en quête de surperformance du côté de l'Europe, les marchés émergents dans leur ensemble et la Chine pourraient rencontrer de solides obstacles en raison de la nature cyclique de ces économies et de la détérioration de la conjoncture.

En général, les actions des marchés émergents surperforment dans les contextes « idéaux » caractérisés par une croissance et des échanges stables voire en hausse au niveau mondial, par des liquidités mondiales suffisantes ou abondantes (rendements et inflation stables ou en recul aux États-Unis/dans le monde et dollar américain invariant ou en baisse) et par des prix des matières premières constants. Un atterrissage en douceur des États-Unis et des marchés développés pourrait apaiser les craintes liées à un « scénario du pire », sans pour autant garantir que celui du meilleur se concrétiserait. En Chine, les perspectives de croissance à long terme sont assombries par un endettement élevé, des marges de manœuvre budgétaires limitées, des doutes concernant le marché immobilier, une dégradation démographique et des tensions géopolitiques. La croissance du PIB réel devrait passer de près de 5 % en 2023 à 3 % au cours des années à venir.

Globalement, nous tablons sur un maintien du climat d'incertitude en 2024, avec une croissance inférieure à la tendance dans l'ensemble des économies de la planète. Si le scénario d'un atterrissage en douceur, à savoir un ralentissement de la croissance, mais sans effondrement, semble possible, le système n'a pas encore digéré tous les effets du resserrement monétaire. En outre, l'économie restera en proie à une escalade des tensions géopolitiques et des turbulences macroéconomiques.

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments

La performance des Compartiments au cours de la période considérée est présentée dans le tableau ci-dessous. La performance est indiquée nette de commissions au 31 décembre 2023 (sauf indication contraire). Le cas échéant, la performance de chaque Compartiment est comparée à celle de l'indice de référence, conformément au Prospectus et au(x) supplément(s).

Compartiments								
Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	29/06/12	6,07	6,09	-0,02	0,65	0,70	-0,05
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	17/06/11	5,91	6,09	-0,18	1,21	1,41	-0,20
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	31/05/12	5,91	6,09	-0,18	0,27	0,47	-0,20
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie P (EUR)	02/05/12	5,76	6,09	-0,33	0,43	0,78	-0,35
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	12/09/12	7,40	7,16	0,24	1,57	1,60	-0,03
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	21/03/12	7,30	7,16	0,14	1,68	1,86	-0,18
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie P (EUR)	25/08/09	7,08	7,16	-0,08	1,78	2,11	-0,33
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	28/02/14	7,08	7,16	-0,08	0,65	0,98	-0,33
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	28/02/14	5,79	5,97	-0,18	2,85	3,08	-0,23
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie B (EUR)	29/06/12	8,39	8,19	0,20	2,19	2,09	0,10
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie I (EUR)	21/07/09	8,23	8,19	0,04	2,67	2,80	-0,13
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	18/10/18	8,23	8,19	0,04	0,02	0,06	-0,04
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie P (EUR)	06/06/13	8,05	8,19	-0,14	1,23	1,47	-0,24
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	24/08/16	8,07	8,19	-0,12	-0,08	0,12	-0,20
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	06/07/11	8,16	8,16	0,00	2,01	2,20	-0,19

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	16/05/11	8,16	8,16	0,00	1,99	2,18	-0,19
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie S (EUR)	24/11/20	8,32	8,16	0,16	-2,51	-2,56	0,05
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie A2 Distribution (EUR)	23/07/15	8,31	8,16	0,15	0,54	0,67	-0,13
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	08/10/14	4,03	4,18	-0,15	-0,60	-0,47	-0,13
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	29/12/22	5,71	5,84	-0,13	5,39	5,64	-0,25
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I (USD)	28/08/09	3,94	4,18	-0,24	0,22	0,45	-0,23
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	13/10/17	1,83	2,16	-0,33	-1,68	-1,37	-0,31
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	18/10/13	3,98	4,36	-0,38	0,40	0,69	-0,29
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	14/12/17	4,02	4,36	-0,34	-1,02	-0,77	-0,25
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	19/04/16	5,45	5,84	-0,39	0,10	0,38	-0,28
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	01/12/17	5,46	5,84	-0,38	-0,01	0,33	-0,34
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	09/08/10	6,33	6,72	-0,39	2,00	2,31	-0,31

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en SGD)	19/01/21	4,84	5,11	-0,27	-2,90	-2,64	-0,26
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie P (USD)	14/06/10	3,78	4,18	-0,40	0,25	0,63	-0,38
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie B (Portefeuille couvert en GBP)	28/06/18	5,97	6,22	-0,25	0,54	0,64	-0,10
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	29/12/22	6,03	6,22	-0,19	5,62	5,97	-0,35
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie I (USD)	10/06/13	5,42	5,72	-0,30	0,21	0,42	-0,21
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	10/04/14	2,09	2,52	-0,43	-0,40	-0,16	-0,24
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	10/04/14	4,29	4,73	-0,44	0,29	0,53	-0,24
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	16/09/14	5,78	6,22	-0,44	1,09	1,34	-0,25
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	10/04/14	6,76	7,15	-0,39	1,94	2,22	-0,28
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)*	27/03/23	s/o	s/o	0,00	3,99	4,24	-0,25
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	27/04/23	s/o	s/o	0,00	10,01	9,95	0,06
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie I (JPY)	28/09/15	28,27	28,51	-0,24	3,29	3,56	-0,27

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	28/09/15	16,00	16,20	-0,20	3,29	3,56	-0,27
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie P (JPY)	28/09/15	27,80	28,50	-0,70	3,01	3,56	-0,55
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie A (CHF)	10/05/22	4,96	5,26	-0,30	-2,26	-1,95	-0,31
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie I (CHF)	28/09/15	5,06	5,26	-0,20	5,45	5,59	-0,14
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie P (EUR)	28/09/15	11,14	11,79	-0,65	6,70	7,19	-0,49
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie P (CHF)	28/09/15	4,64	5,26	-0,62	5,09	5,46	-0,37
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie S (CHF)	24/08/17	5,18	5,26	-0,08	5,03	5,12	-0,09
State Street UK Index Equity Fund	Catégorie I (GBP)	28/09/15	7,28	7,66	-0,38	5,80	5,90	-0,10
State Street UK Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	28/09/15	9,85	10,23	-0,38	5,35	5,63	-0,28
State Street UK Index Equity Fund	Catégorie P (GBP)	28/09/15	6,86	7,66	-0,80	5,52	5,90	-0,38
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	28/09/15	26,74	26,69	0,05	12,60	12,61	-0,01
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)	29/12/22	19,58	19,54	0,04	19,42	19,38	0,04
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie I (USD)	28/09/15	26,48	26,69	-0,21	8,15	8,30	-0,15
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	28/09/15	22,24	22,40	-0,16	13,84	14,08	-0,24
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie I (VNI couverte en EUR)	28/09/15	23,07	23,18	-0,11	11,06	11,26	-0,20
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie P (USD)	28/09/15	25,98	26,69	-0,71	7,86	8,30	-0,44
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie A (EUR)	25/01/21	19,09	18,96	0,13	8,43	8,33	0,10
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie B (EUR)	28/09/15	19,50	18,96	0,54	6,40	5,90	0,50
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	28/09/15	19,26	18,96	0,30	4,51	4,23	0,28
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	01/08/17	19,26	18,96	0,30	5,82	5,53	0,29
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie P (EUR)	28/09/15	18,73	18,96	-0,23	4,21	4,23	-0,02
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie B (EUR)	25/07/19	16,35	16,05	0,30	7,14	6,90	0,24
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)	29/12/22	13,64	13,34	0,30	12,20	12,13	0,07

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	28/09/15	16,12	16,05	0,07	6,80	6,75	0,05
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	16/11/16	16,12	16,05	0,07	7,52	7,45	0,07
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie P (EUR)	28/09/15	15,63	16,05	-0,42	6,42	6,75	-0,33
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie I (USD)	28/09/15	5,23	5,36	-0,13	6,19	6,45	-0,26
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	16/04/18	1,66	1,79	-0,13	4,57	4,79	-0,22
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie P (USD)	28/09/15	4,82	5,36	-0,54	5,77	6,45	-0,68
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	27/04/23	s/o	s/o	0,00	1,05	0,53	0,52
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	28/04/23	s/o	s/o	0,00	11,44	11,35	0,09
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie B (Distribution couverte en GBP)*	03/01/23	s/o	s/o	0,00	22,75	22,55	0,20
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	28/09/15	24,08	23,98	0,10	9,70	9,63	0,07
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie B (Portefeuille couvert en USD)	16/09/16	24,58	24,50	0,08	11,96	11,91	0,05
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I (USD)	28/09/15	23,83	23,98	-0,15	6,45	6,57	-0,12
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (USD)*	10/07/23	s/o	s/o	0,00	8,71	8,79	-0,08
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	28/09/15	19,63	19,78	-0,15	7,71	7,83	-0,12
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	30/09/19	21,10	21,20	-0,10	9,25	9,32	-0,07

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	04/10/22	21,04	21,15	-0,11	9,24	9,32	-0,08
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I (GBP)	18/01/18	16,85	16,98	-0,13	9,59	9,70	-0,11
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en CHF)	14/07/21	18,50	18,37	0,13	1,00	1,11	-0,11
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	15/07/21	22,62	22,66	-0,04	3,31	3,39	-0,08
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I (SEK)	08/09/21	19,77	19,91	-0,14	8,66	8,80	-0,14
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en SEK)	19/05/21	20,77	21,21	-0,44	4,12	4,48	-0,36
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	13/07/21	24,26	24,50	-0,24	4,70	4,89	-0,19
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie P (USD)	28/09/15	23,34	23,98	-0,64	6,15	6,57	-0,42
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie P (Portefeuille couvert en EUR)	28/09/15	20,58	21,15	-0,57	10,22	10,79	-0,57
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie P (Portefeuille couvert en SEK)	02/07/21	20,29	21,21	-0,92	1,67	2,34	-0,67
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie P (SEK)	02/08/21	19,30	19,91	-0,61	9,25	9,84	-0,59
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie S (USD)	19/06/20	24,00	23,98	0,02	12,39	12,39	0,00
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie S Distribution (USD)	19/06/20	24,00	23,98	0,02	12,39	12,39	0,00
State Street World ESG Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	15/01/16	24,00	23,89	0,11	11,94	11,92	0,02

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street World ESG Index Equity Fund	Catégorie I (USD)	28/09/15	23,75	23,89	-0,14	7,40	7,69	-0,29
State Street World ESG Index Equity Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	18/06/20	20,87	20,98	-0,11	10,98	11,07	-0,09
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	27/04/23	s/o	s/o	0,00	5,08	5,01	0,07
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	28/09/15	9,83	9,80	0,03	2,46	2,41	0,05
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie I (USD)	28/09/15	9,51	9,80	-0,29	2,00	2,40	-0,40
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie I (GBP)	16/11/20	3,33	3,61	-0,28	-2,24	-1,94	-0,30
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie P (USD)	28/09/15	8,47	9,80	-1,33	7,15	8,93	-1,78
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie I (SEK)	07/09/21	-6,10	-6,20	-0,10	-0,31	-2,41	-1,57
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	Catégorie B (EUR)	01/05/15	11,94	3,25	8,69	3,59	0,08	3,51
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	Catégorie I (EUR)	01/05/15	11,32	3,25	8,07	2,58	0,08	2,50
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	Catégorie P (EUR)	01/05/15	10,67	3,25	7,42	3,54	2,96	0,58
State Street Europe Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	17/05/13	21,10	15,83	5,27	6,37	6,75	-0,38
State Street Europe Value Spotlight Fund	Catégorie I (EUR)	12/06/15	20,13	15,83	4,30	3,27	5,01	-1,74
State Street Europe Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	28/05/13	19,16	15,83	3,33	4,75	6,77	-2,02
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	20/08/13	26,22	18,78	7,44	8,54	7,26	1,28
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	Catégorie I (EUR)	06/02/14	25,27	18,78	6,49	6,97	6,63	0,34
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	23/09/13	24,29	18,78	5,51	6,58	6,83	-0,25
State Street US Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	14/09/15	12,38	21,41	-9,03	9,97	13,11	-3,14
State Street US Value Spotlight Fund	Catégorie I (USD)	08/07/15	15,44	25,67	-10,23	7,55	11,93	-4,38
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	14/09/15	11,01	7,67	3,34	8,67	6,26	2,41

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund	Catégorie I (USD)	08/07/15	14,04	11,45	2,59	6,46	4,76	1,70
State Street Global Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	17/12/12	10,32	19,60	-9,28	9,30	11,89	-2,59
State Street Global Value Spotlight Fund	Catégorie I (EUR)	24/05/13	9,50	19,60	-10,10	7,50	10,93	-3,43
State Street Global Value Spotlight Fund	Catégorie I (USD)	28/04/21	13,32	23,79	-10,47	-0,01	4,31	-4,32
State Street Global Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	07/05/13	8,63	19,60	-10,97	6,93	11,03	-4,10
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	Catégorie B (USD)	10/02/17	19,00	23,79	-4,79	7,13	10,33	-3,20
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)	29/12/22	12,30	16,81	-4,51	11,94	16,54	-4,60
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	Catégorie I (USD)	30/09/14	18,57	23,79	-5,22	6,12	8,88	-2,76
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (EUR)	03/06/16	16,15	15,83	0,32	7,00	7,24	-0,23
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie P (EUR)	01/05/15	15,88	15,83	0,05	6,06	6,14	-0,08
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	20/05/16	24,53	25,96	-1,43	12,19	12,91	-0,72
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie P (USD)	01/05/15	24,24	25,96	-1,72	9,07	9,50	-0,43
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	10/02/15	23,73	23,79	-0,06	8,61	9,01	-0,40
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I Distribution (USD)	10/02/15	23,72	23,79	-0,07	8,55	9,01	-0,46
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	04/12/12	11,34	9,83	1,51	2,96	2,60	0,36
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	Catégorie I (EUR)	10/11/17	7,57	6,11	1,46	1,69	1,75	-0,06

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie B (GBP)	23/04/19	7,53	3,63	3,90	2,73	1,52	1,21
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	06/05/10	13,43	9,83	3,60	3,55	3,04	0,51
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (EUR)	06/05/10	9,59	6,11	3,48	3,78	3,30	0,48
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie P (USD)	04/05/16	12,82	9,83	2,99	5,68	5,60	0,08
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie P (EUR)	21/09/17	9,00	6,11	2,89	2,47	2,42	0,05
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie I (EUR)	21/01/09	18,06	18,78	-0,72	9,04	8,21	0,83
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie P (EUR)	09/04/15	16,85	18,78	-1,93	7,94	8,21	-0,27
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	01/05/15	16,85	18,78	-1,93	4,59	4,93	-0,34
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P (EUR)	01/05/15	11,47	12,74	-1,27	7,98	6,84	1,14
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	21/09/17	11,47	12,74	-1,27	4,58	4,37	0,21
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie A (USD)	04/03/19	31,39	23,92	7,47	10,17	8,66	1,51
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie I (USD)	21/12/16	31,58	23,92	7,66	10,33	8,43	1,90
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie I (EUR)	10/11/17	27,12	19,72	7,40	8,25	6,28	1,97
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P (USD)	08/11/19	30,09	23,92	6,17	10,88	10,42	0,46
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie A (USD)	01/04/15	2,41	23,79	-21,38	5,48	9,02	-3,54

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie B (USD)	29/06/12	2,89	23,79	-20,90	8,08	10,52	-2,44
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie I (USD)	24/03/10	2,54	23,79	-21,25	7,96	9,43	-1,47
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	30/03/16	-0,93	19,60	-20,53	5,64	11,07	-5,43
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie I (EUR)	24/11/14	-0,93	19,60	-20,53	7,18	10,14	-2,96
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	17/09/21	0,91	20,96	-20,05	0,97	1,89	-0,92
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie P (USD)	31/05/13	1,92	23,79	-21,87	6,31	9,45	-3,14
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	Catégorie B (EUR)	25/07/19	4,02	19,60	-15,58	5,63	10,48	-4,85
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	Catégorie I (USD)	28/10/15	6,86	23,79	-16,93	5,92	9,72	-3,80
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I (USD)	04/09/19	3,86	4,00	-0,14	-1,93	-1,76	-0,17
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	04/09/19	1,51	1,76	-0,25	-2,17	-1,98	-0,19
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	04/09/19	3,68	3,93	-0,25	-1,42	-1,23	-0,19
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	04/09/19	3,71	3,93	-0,22	-1,45	-1,23	-0,22

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	04/09/19	5,12	5,42	-0,30	-0,38	-0,16	-0,22
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	04/09/19	5,86	6,16	-0,30	0,23	0,44	-0,21
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	04/09/19	5,90	6,16	-0,26	0,28	0,44	-0,16
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	07/04/21	12,83	12,70	0,13	-1,43	-1,52	0,09
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B Distribution (GBP)	29/12/22	6,46	6,34	0,12	6,57	6,53	0,04
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (USD)	23/02/21	12,66	12,70	-0,04	-2,79	-2,70	-0,09
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	25/09/19	8,84	8,89	-0,05	-0,83	-0,67	-0,16
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (USD)	25/09/19	12,66	12,70	-0,04	-0,64	-0,48	-0,16
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	30/06/20	9,06	9,83	-0,77	1,66	3,33	-1,67
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	Catégorie P (EUR)	02/12/21	4,71	6,11	-1,40	-7,86	-5,05	-2,81
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	Catégorie P (USD)	02/12/21	8,44	9,83	-1,39	-8,90	-6,15	-2,75
State Street Global Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	25/09/20	32,20	22,20	10,00	12,29	10,41	1,88
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	Catégorie I (USD)	19/05/21	8,33	8,52	-0,19	-2,38	-2,27	-0,11

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	Catégorie I (couverte en EUR)	11/06/21	5,56	5,80	-0,24	-5,26	-5,18	-0,08
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	Catégorie S (USD)	19/05/21	8,39	8,52	-0,13	-2,34	-2,27	-0,07
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie B (EUR)	31/03/22	8,31	8,19	0,12	-1,23	-0,97	-0,26
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie I (EUR)	19/05/21	8,10	8,19	-0,09	-2,77	-2,52	-0,25
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	23/03/22	8,06	8,19	-0,13	-1,27	-0,94	-0,33
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie P (EUR)	02/12/21	7,79	8,19	-0,40	-4,03	-3,43	-0,60
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie S (EUR)	19/05/21	8,15	8,19	-0,04	-2,72	-2,52	-0,20
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie B (USD)	17/11/21	13,69	13,41	0,28	-0,45	-0,56	0,11
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie B (Portefeuille couvert en EUR)	17/11/21	10,65	10,35	0,30	-2,04	-2,17	0,13
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie I (USD)	29/04/21	13,52	13,41	0,11	-0,84	-0,66	-0,18
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	29/04/21	8,15	7,96	0,19	-2,61	-2,48	-0,13
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	29/04/21	10,45	10,35	0,10	-1,72	-1,51	-0,21

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	29/06/21	12,07	11,92	0,15	-1,08	-0,98	-0,10
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	29/04/21	13,02	12,97	0,05	0,28	0,52	-0,24
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en NOK)	30/11/21	10,93	10,75	0,18	-1,10	-1,00	-0,10
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	20/05/22	14,18	14,06	0,12	9,16	9,03	0,13
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (USD)	14/12/21	14,01	14,06	-0,05	0,73	0,82	-0,09
State Street US Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	31/01/22	27,29	25,67	1,62	3,16	4,11	-0,95
State Street China Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	07/02/22	-14,39	-10,97	-3,42	-20,34	-16,52	-3,82
State Street Sustainable Climate World Equity Fund	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	03/01/23	s/o	s/o	0,00	22,45	22,36	0,09
State Street Sustainable Climate World Equity Fund	Catégorie I (USD)	20/04/22	23,11	23,79	-0,68	3,94	5,11	-1,17
State Street Sustainable Climate US Equity Fund	Catégorie I (USD)	27/06/22	25,55	26,49	-0,94	15,14	15,81	-0,67
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)**	14/10/22	11,10	11,09	0,01	1,80	1,70	0,10
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	26/04/23	s/o	s/o	0,00	8,01	8,07	-0,06
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (USD)**	14/10/22	11,21	11,09	0,12	1,94	1,70	0,24

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Compartiments (suite)								
Nom du Compartiment (suite)	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement – Annualisé		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)*	15/12/23	s/o	s/o	0,00	0,56	0,56	0,00
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (USD)*	15/12/23	s/o	s/o	0,00	0,79	0,84	-0,05

* Il n'existe pas de donnée de performance sur 1 an étant donné que la catégorie d'actions a été lancée au cours de 2023.

** Ce compartiment dispose de données de performance étant donné qu'il a absorbé un autre fonds et que les données de performance du fonds absorbé ont été intégrées (date de lancement : 26/06/2018).

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.

Rapport des Gestionnaires financiers (suite)

Performance des Compartiments (suite)

Catégories d'actions et Compartiments clôturés								
Nom du Compartiment	Catégorie d'actions	Date de création	1 an			Depuis le lancement		
			Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %	Catégorie d'actions %	Indice de référence %	Différence %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie B (USD)(a)	18/12/15	-7,19	-5,53	-1,66	6,17	5,61	0,56
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	Catégorie B (USD)(b)	18/10/19	0,15	1,60	-1,45	4,96	8,92	-3,96
State Street Global Opportunities Equity Fund	Catégorie B (USD)(b)	17/11/21	1,60	0,77	0,83	-12,85	-9,10	-3,75
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie A2 (EUR)(c)	23/10/15	-3,04	-3,20	0,16	-0,05	0,03	-0,08
State Street Canada Index Equity Fund	Catégorie I (CAD)(d)	31/08/08	8,10	8,14	-0,04	4,64	4,67	-0,03
State Street Canada Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)(d)	13/04/18	1,93	1,96	-0,03	9,18	9,24	-0,06
State Street Canada Index Equity Fund	Catégorie P (CAD)(d)	30/04/97	7,70	8,14	-0,44	6,30	7,19	-0,89
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	Catégorie P (USD)(e)	02/12/21	-1,11	-0,73	-0,38	-9,63	-9,32	-0,31
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	Catégorie I (EUR)(f)	30/06/20	2,26	4,03	-1,77	-0,02	1,95	-1,97
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	Catégorie P (EUR)(g)	08/04/21	3,55	3,83	-0,28	-1,04	-0,70	-0,34
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B (JPY)(h)	28/03/13	27,86	27,84	0,02	9,91	9,91	s/o
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)(h)	25/09/15	3,14	2,90	0,24	6,15	6,17	-0,02

(a) Cette catégorie d'actions a été liquidée le 3 avril 2023.

(b) Cette catégorie d'actions a été liquidée le 4 avril 2023.

(c) Cette catégorie d'actions a été liquidée le 15 mai 2023.

(d) Cette catégorie d'actions a été liquidée le 14 juin 2023.

(e) Cette catégorie d'actions a été liquidée le 2 octobre 2023.

(f) Cette catégorie d'actions a été liquidée le 27 octobre 2023.

(g) Cette catégorie d'actions a été liquidée le 1^{er} décembre 2023.

(h) Cette catégorie d'actions a été liquidée le 20 décembre 2023.

Les chiffres mentionnés dans ce rapport sont basés sur des données historiques et ne préfigurent pas des performances futures.



Rapport d'audit

À l'attention des Actionnaires de
State Street Global Advisors Luxembourg SICAV

Notre opinion

À notre avis, les états financiers donnent une image sincère et fidèle de la situation financière de State Street Global Advisors Luxembourg SICAV (le « Fonds ») et de chacun de ses Compartiments au 31 décembre 2023, ainsi que de son résultat d'exploitation et de la variation de ses actifs nets pour l'exercice clôturé à cette date, conformément aux règles légales et réglementaires luxembourgeoises de préparation et de présentation des états financiers.

Documents audités

Les états financiers du Fonds comprennent :

- l'État consolidé des Actifs nets au 31 décembre 2023 ;
- le tableau des investissements au 31 décembre 2023 ;
- le Compte de résultat consolidé pour l'exercice clôturé à cette date ;
- l'État consolidé des variations des actifs nets pour l'exercice clôturé à cette date ; et
- les notes aux états financiers, incluant une synthèse des méthodes comptables significatives.

Fondement de notre avis

Nous avons effectué notre audit conformément à la loi du 23 juillet 2016 sur la profession de l'audit (« Loi du 23 juillet 2016 ») et aux normes internationales d'audit, (*International Standards on Auditing*, « ISA ») adoptées pour le Luxembourg par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (« CSSF »). Les responsabilités qui nous sont attribuées en vertu de la Loi du 23 juillet 2016 et des normes ISA telles qu'adoptées par la CSSF au Luxembourg sont décrites en détail à la section de notre rapport intitulée « Responsabilités du réviseur d'entreprise agréé au titre de l'audit des états financiers ».

Nous estimons que nous avons réuni suffisamment d'éléments probants pertinents pour fonder notre opinion.

Nous sommes une société indépendante du Fonds, conformément au Code international de déontologie pour les Experts-comptables (en ce compris les normes internationales d'indépendance) publié par l'*International Ethics Standards Board for Accountants* (« Code IESBA ») et adopté pour le Luxembourg par la CSSF, ainsi qu'aux règles de déontologie qui s'appliquent à l'audit des états financiers que nous avons réalisé. Nous nous sommes acquittés des autres responsabilités que nous imposent ces règles en matière de déontologie.

Autres informations

Le Conseil d'administration du Fonds est responsable de la divulgation des autres informations. Les autres informations comprennent les informations qui figurent dans le rapport annuel, mais n'incluent pas les états financiers ni notre rapport d'audit y afférent.

Notre avis concernant les états financiers ne porte pas sur les autres informations et nous ne formulons aucune forme de certitude à cet égard.

Concernant notre audit des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations identifiées ci-dessus et, à cette occasion, à évaluer si les autres informations présentent des inexactitudes importantes par rapport aux états financiers ou aux informations que nous avons obtenues lors de l'audit, ou bien si elles semblent comporter des erreurs significatives. Si, en fonction du travail que nous avons effectué, nous concluons que ces autres informations présentent des erreurs significatives, nous sommes tenus de le signaler. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

Responsabilité du Conseil d'administration du Fonds au titre des états financiers

Le Conseil d'administration du Fonds est responsable de la préparation et de la présentation fidèle des états financiers conformément aux exigences légales et réglementaires luxembourgeoises concernant la préparation et de la présentation des états financiers, ainsi que du contrôle interne qu'il estime nécessaire afin de permettre la préparation d'états financiers exempts d'inexactitudes importantes, que celles-ci relèvent de fraudes ou d'erreurs.

En préparant les états financiers, le Conseil d'administration du Fonds est chargé d'évaluer la capacité du Fonds et de chacun de ses compartiments à préserver une situation de continuité d'exploitation, de faire connaître, s'il y a lieu, les questions relatives à la situation de continuité d'exploitation et de prendre pour fondement de la comptabilité une situation de continuité d'exploitation, à moins que le Conseil d'administration du Fonds ou bien ait l'intention, ou bien n'ait d'autre choix que de liquider le Fonds ou clôturer l'un de ses compartiments, ou de cesser les opérations.

Responsabilités du Réviseur d'entreprise agréé au titre de l'audit des états financiers

Les objectifs de notre audit consistent à obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers, dans l'ensemble, soient exempts d'inexactitudes importantes, de nature intentionnelle ou non, et à rendre un rapport d'audit assorti de notre avis. L'assurance raisonnable correspond à un niveau de certitude élevé, mais ne garantit pas que l'audit conduit conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux normes ISA adoptées pour le Luxembourg par la CSSF détecte systématiquement une éventuelle inexactitude importante. Les inexactitudes peuvent être de nature intentionnelle ou non et sont considérées comme importantes si, individuellement ou dans leur ensemble, l'on peut raisonnablement s'attendre à ce qu'elles influencent les décisions économiques des utilisateurs prises sur la base des présents états financiers.

Dans le cadre de notre audit, conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux normes ISA adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, nous exerçons un jugement professionnel et conservons une attitude de scepticisme professionnel tout au long de l'audit. Par ailleurs :

- nous identifions et évaluons les risques que les états financiers présentent des inexactitudes importantes, de nature intentionnelle ou non, concevons et exécutons des procédures d'audit pour réagir à ces risques, et obtenons des éléments probants qui soient suffisants et adéquats pour servir de fondement à notre opinion. Le risque de ne pas détecter une anomalie significative relevant d'une fraude est plus élevé que pour une anomalie relevant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions intentionnelles, les fausses déclarations, ou le contournement du contrôle interne ;
- nous prenons connaissance des procédures de contrôle interne utiles à l'audit, afin de concevoir des procédures de révision adaptées aux circonstances, mais non pour exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne du Fonds ;
- nous évaluons le caractère approprié des méthodes comptables utilisées et le caractère raisonnable des estimations comptables et des informations connexes fournies par le Conseil d'administration du Fonds ;



- nous formulons une conclusion quant à savoir s'il convenait que le Conseil d'administration adopte le principe de continuité de l'exploitation et, sur la base des éléments probants obtenus, quant à l'existence d'une incertitude significative liée à des événements ou à des circonstances susceptibles de jeter un doute important sur la capacité du Fonds ou de l'un de ses compartiments à demeurer en situation de poursuivre son activité. Si nous concluons à l'existence d'une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention, dans notre rapport d'audit, sur les informations communiquées correspondantes dans les états financiers ou, si ces informations communiquées sont inadéquates, de modifier notre opinion. Nos conclusions reposent sur les éléments probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport d'audit. Toutefois, des circonstances ou des événements futurs peuvent conduire le Fonds ou l'un de ses compartiments à ne plus être en situation de poursuivre son activité ;
- nous évaluons la présentation d'ensemble, la structure et la teneur des états financiers, y compris les informations à fournir, et nous déterminons si les états financiers représentent les opérations et événements sous-jacents de manière à parvenir à une présentation fidèle.

Nous sommes en relation avec les personnes chargées de la gouvernance concernant, entre autres, le champ d'application et le calendrier prévus pour l'audit ainsi que les constatations importantes effectuées au cours de nos vérifications, ce qui recouvre les carences importantes du contrôle interne que nous identifions au cours de nos travaux.

Nous fournissons également aux personnes chargées de la gouvernance une déclaration attestant que nous nous sommes conformés aux règles de déontologie applicables en matière d'indépendance, et nous leur communiquons toutes les relations et autres considérations dont on peut raisonnablement penser qu'elles ont une incidence sur notre indépendance, ainsi que, le cas échéant, les mesures prises à cet effet ou les protections mises en place.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Représentée par

Luxembourg, le 22 avril 2024

Marie-Elisa Roussel

État consolidé des actifs nets

		Consolidé EUR	State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund EUR	State Street EMU Government Bond Index Fund EUR	State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund EUR	State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund EUR	State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund EUR	State Street Global Treasury Bond Index Fund USD
Au 31 décembre 2023	Notes							
ACTIFS								
Investissements en titres, à la valeur de marché	2c	31 314 315 266	644 825 386	262 136 620	68 543 307	842 596 381	305 446 812	1 972 152 465
Trésorerie et actifs liquides		350 694 148	497 404	362 157	86 449	2 656 558	816 410	23 909 546
Dividendes et intérêts à recevoir	2h	190 777 479	6 072 535	2 854 307	219 338	10 749 900	3 711 905	13 471 704
Montants à recevoir sur cession de titres d'investissement		27 319 162	–	178 850	–	–	196 778	5 285 251
Montants à recevoir sur cessions d'actions de fonds		35 464 219	32 948	–	–	64 041	165 527	8 769 376
Remboursement à recevoir du Gestionnaire financier	3b	1 075 864	5 890	–	38 590	8 630	12 973	2 492
Appréciation latente sur contrats de change à terme	2g	879 660	–	–	–	–	–	–
Appréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	111 246 103	–	–	–	–	–	11 804 416
Appréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	7 182 924	–	–	–	–	–	–
Autres actifs		352 063	–	–	–	–	–	–
Total des actifs		32 039 306 888	651 434 163	265 531 934	68 887 684	856 075 510	310 350 405	2 035 395 250
PASSIFS								
Découverts bancaires		168 394	–	–	–	–	–	–
Montants à payer sur achat de titres d'investissement		46 952 432	–	–	–	–	–	6 595 575
Montants à payer sur rachats d'actions		9 157 985	829	115 664	–	1 420 000	125 636	555 715
Charges constatées et autres passifs		7 450 305	99 303	78 244	59 016	165 990	96 589	355 536
Commissions dues au Gestionnaire financier	3b	4 606 270	53 059	23 007	8 721	77 516	55 760	295 030
Dépréciation latente sur contrats de change à terme	2g	705 532	–	–	–	–	–	–
Dépréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	147 144 009	–	–	–	–	–	23 422 784
Dépréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	70 186	–	–	–	–	–	–
Total des passifs		216 255 113	153 191	216 915	67 737	1 663 506	277 985	31 224 640
TOTAL DES ACTIFS NETS		31 823 051 775	651 280 972	265 315 019	68 819 947	854 412 004	310 072 420	2 004 170 610

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des actifs nets (suite)

		State Street Global Aggregate Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Japan Screened Index Equity Fund JPY	State Street Switzerland Index Equity Fund CHF	State Street UK Index Equity Fund GBP	State Street US Screened Index Equity Fund USD	State Street EMU Screened Index Equity Fund EUR	State Street Europe Screened Index Equity Fund EUR
Au 31 décembre 2023	Notes							
ACTIFS								
Investissements en titres, à la valeur de marché	2c	6 556 134 107	25 051 029 370	219 113 128	94 280 243	1 594 027 974	266 049 683	628 406 192
Trésorerie et actifs liquides		96 904 414	349 811 342	224 248	301 769	6 630 413	520 896	1 809 281
Dividendes et intérêts à recevoir	2h	51 407 166	31 004 494	–	280 987	1 077 147	806 638	2 358 409
Montants à recevoir sur cession de titres d'investissement		10 320 907	–	531 718	–	–	–	–
Montants à recevoir sur cessions d'actions de fonds		4 096 228	133 401 038	9 091	1 932	162 352	1 214	28 628
Remboursement à recevoir du Gestionnaire financier	3b	–	2 802 783	21 288	34 899	1	45 562	48 378
Appréciation latente sur contrats de change à terme	2g	–	–	–	–	–	–	–
Appréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	31 695 465	–	–	–	5 776 321	–	–
Appréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	–	3 770 650	–	12 130	189 090	–	12 016
Autres actifs		–	–	–	–	–	–	–
Total des actifs		6 750 558 287	25 571 819 677	219 899 473	94 911 960	1 607 863 298	267 423 993	632 662 904
PASSIFS								
Découverts bancaires		–	162	–	6	–	3	–
Montants à payer sur achat de titres d'investissement		17 169 866	25 903 230	–	–	–	–	–
Montants à payer sur rachats d'actions		71 482	6 260 017	542 976	456	200 282	200 789	573
Charges constatées et autres passifs		630 182	12 748 859	94 482	62 768	237 426	115 841	185 030
Commissions dues au Gestionnaire financier	3b	373 551	3 226 254	33 993	20 343	264 394	47 789	115 057
Dépréciation latente sur contrats de change à terme	2g	–	–	–	–	–	–	–
Dépréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	56 859 838	–	–	–	2 433 879	–	–
Dépréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	–	–	960	–	–	1 050	8 657
Total des passifs		75 104 919	48 138 522	672 411	83 573	3 135 981	365 472	309 317
TOTAL DES ACTIFS NETS		6 675 453 368	25 523 681 155	219 227 062	94 828 387	1 604 727 317	267 058 521	632 353 587

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des actifs nets (suite)

		State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund USD	State Street World Screened Index Equity Fund ^(a) USD	State Street World ESG Index Equity Fund USD	State Street Global Emerging Markets Screened Index ^(a) Equity Fund USD	State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund EUR	State Street Europe Value Spotlight Fund EUR	State Street Eurozone Value Spotlight Fund EUR
Au 31 décembre 2023	Notes							
ACTIFS								
Investissements en titres, à la valeur de marché	2c	66 203 380	4 629 430 809	2 388 628 659	618 134 860	173 623 493	20 002 494	38 198 414
Trésorerie et actifs liquides		560 520	35 820 303	14 616 959	2 668 073	19 465 186	101 710	107 571
Dividendes et intérêts à recevoir	2h	35 769	5 560 884	2 107 081	1 728 108	349 499	189 622	150 240
Montants à recevoir sur cession de titres d'investissement		–	–	–	716 062	–	–	–
Montants à recevoir sur cessions d'actions de fonds		29 822	1 569 961	1 488 442	766 435	–	–	193
Remboursement à recevoir du Gestionnaire financier	3b	718	23 118	46	20 853	23 111	51 952	43 472
Appréciation latente sur contrats de change à terme	2g	–	–	–	–	–	–	–
Appréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	–	9 255 027	1 791 532	–	–	–	–
Appréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	11 798	899 217	386 184	83 405	4 455 372	–	–
Autres actifs		15 598	5 202	–	–	5 652	–	–
Total des actifs		66 857 605	4 682 564 521	2 409 018 903	624 117 796	197 922 313	20 345 778	38 499 890
PASSIFS								
Découverts bancaires		–	–	–	–	–	–	–
Montants à payer sur achat de titres d'investissement		22 298	–	–	716 063	1 980 567	–	–
Montants à payer sur rachats d'actions		4 091	2 005 241	–	54 181	–	–	114
Charges constatées et autres passifs		93 532	867 103	403 334	310 690	92 567	72 533	69 988
Commissions dues au Gestionnaire financier	3b	14 922	748 077	250 269	121 087	22 977	–	349
Dépréciation latente sur contrats de change à terme	2g	–	–	–	–	–	–	–
Dépréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	–	6 471 237	1 311 140	–	–	–	–
Dépréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	–	40 426	–	–
Total des passifs		134 843	10 091 658	1 964 743	1 202 021	2 136 537	72 533	70 451
TOTAL DES ACTIFS NETS		66 722 762	4 672 472 863	2 407 054 160	622 915 775	195 785 776	20 273 245	38 429 439

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des actifs nets (suite)

		State Street US Value Spotlight Fund USD	State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund USD	State Street Global Value Spotlight Fund EUR	State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund ^(a) USD	State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund EUR	State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund USD	State Street Global ESG Screened Enhanced ^(a) Equity Fund USD
Au 31 décembre 2023	Notes							
ACTIFS								
Investissements en titres, à la valeur de marché	2c	27 187 569	64 294 833	51 722 250	300 523 392	355 411 687	577 267 587	84 391 740
Trésorerie et actifs liquides		527 210	577 195	599 877	2 631 378	1 234 007	8 340 836	3 240 323
Dividendes et intérêts à recevoir	2h	27 008	466 306	69 375	549 035	1 010 813	533 283	195 756
Montants à recevoir sur cession de titres d'investissement		—	—	—	—	—	—	—
Montants à recevoir sur cessions d'actions de fonds		—	317 864	—	588 023	17 664	—	3 412 433
Remboursement à recevoir du Gestionnaire financier	3b	49 497	50 853	51 689	18	5 673	32	46 293
Appréciation latente sur contrats de change à terme	2g	—	—	10 931	—	—	—	—
Appréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	—	—	—	—	—	—	—
Appréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	—	—	—	11 430	7 212	236 710	10 550
Autres actifs		715	561	—	4 272	22 337	—	4 272
Total des actifs		27 791 999	65 707 612	52 454 122	304 307 548	357 709 393	586 378 448	91 301 367
PASSIFS								
Découverts bancaires		—	—	—	—	—	—	—
Montants à payer sur achat de titres d'investissement		—	—	121 093	—	—	—	4 520 990
Montants à payer sur rachats d'actions		—	45 353	45 410	147 623	—	—	—
Charges constatées et autres passifs		70 867	77 115	73 592	111 892	102 568	117 753	79 788
Commissions dues au Gestionnaire financier	3b	116	22 258	3 149	31	106 677	152 280	23 735
Dépréciation latente sur contrats de change à terme	2g	—	—	196 703	—	—	—	—
Dépréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	—	—	—	—	—	—	—
Dépréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	—	—	—	—	3 438	—	—
Total des passifs		70 983	144 726	439 947	259 546	212 683	270 033	4 624 513
TOTAL DES ACTIFS NETS		27 721 016	65 562 886	52 014 175	304 048 002	357 496 710	586 108 415	86 676 854

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des actifs nets (suite)

		State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund USD	State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund USD	State Street EMU ESG Screened Equity Fund EUR	State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund EUR	State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund USD	State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund USD	State Street Global ESG Screened Equity Defensive Equity Fund USD
Au 31 décembre 2023	Notes							
ACTIFS								
Investissements en titres, à la valeur de marché	2c	837 027 180	548 415 931	26 373 694	21 536 519	229 956 568	277 088 182	107 737 583
Trésorerie et actifs liquides		21 015 497	13 759 814	179 971	223 567	3 419 365	846 976	475 097
Dividendes et intérêts à recevoir	2h	3 651 486	2 447 557	51 591	96 192	1 018 614	374 751	338 003
Montants à recevoir sur cession de titres d'investissement		–	583 901	4 458	14 516	–	271 996	–
Montants à recevoir sur cessions d'actions de fonds		1 732 788	8 608	–	2 009	125 732	9 789	–
Remboursement à recevoir du Gestionnaire financier	3b	–	3 821	37 918	41 779	333	–	26 025
Appréciation latente sur contrats de change à terme	2g	–	–	–	–	–	–	–
Appréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	–	–	–	–	–	413 349	–
Appréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	440 105	599 932	–	6 060	–	26 720	–
Autres actifs		–	72 601	4 087	35 557	–	–	4 272
Total des actifs		863 867 056	565 892 165	26 651 719	21 956 199	234 520 612	279 031 763	108 580 980
PASSIFS								
Découverts bancaires		–	186 005	–	–	–	–	–
Montants à payer sur achat de titres d'investissement		–	583 901	–	–	–	–	–
Montants à payer sur rachats d'actions		–	38 850	5	–	53 695	47 443	–
Charges constatées et autres passifs		364 830	298 853	72 230	78 945	195 867	218 392	75 497
Commissions dues au Gestionnaire financier	3b	318 429	208 668	33 291	45 819	231 474	239 073	43 302
Dépréciation latente sur contrats de change à terme	2g	–	–	–	–	–	–	–
Dépréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	–	–	–	–	–	184 787	–
Dépréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	–	–	1 500	–	–	–	–
Total des passifs		683 259	1 316 277	107 026	124 764	481 036	689 695	118 799
TOTAL DES ACTIFS NETS		863 183 797	564 575 888	26 544 693	21 831 435	234 039 576	278 342 068	108 462 181

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des actifs nets (suite)

		State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund USD	State Street Global Opportunities Equity Fund USD	State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund USD	State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund EUR	State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund USD
Au 31 décembre 2023								
Notes								
ACTIFS								
Investissements en titres, à la valeur de marché	2c	4 692 976 958	2 195 810 107	26 077 694	191 972 974	265 961 001	273 008 540	505 866 419
Trésorerie et actifs liquides		58 260 855	41 499 684	293 488	5 429 423	868 353	899 266	4 001 100
Dividendes et intérêts à recevoir	2h	29 626 241	37 720 765	63 548	186 104	2 808 295	3 003 091	8 999 213
Montants à recevoir sur cession de titres d'investissement		–	9 890 843	–	–	–	–	79 875
Montants à recevoir sur cessions d'actions de fonds		13 693 378	334 709	–	–	–	–	21 947
Remboursement à recevoir du Gestionnaire financier	3b	15 748	–	–	2	480	3 362	36 228
Appréciation latente sur contrats de change à terme	2g	–	924 654	–	–	–	–	–
Appréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	49 347 678	–	–	–	817 991	–	8 002 164
Appréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	–	–	–	–
Autres actifs		2 006	12 009	172 101	–	–	–	–
Total des actifs		4 843 922 864	2 286 192 771	26 606 831	197 588 503	270 456 120	276 914 259	527 006 946
PASSIFS								
Découverts bancaires		–	–	–	–	–	–	–
Montants à payer sur achat de titres d'investissement		6 759 882	10 536 282	–	–	–	–	591 247
Montants à payer sur rachats d'actions		3 779 323	16 081	4 632	–	–	385	117 763
Charges constatées et autres passifs		461 841	603 261	166 331	68 442	77 004	84 316	149 038
Commissions dues au Gestionnaire financier	3b	281 425	252 075	38 149	76 461	91 475	91 249	56 670
Dépréciation latente sur contrats de change à terme	2g	–	542 136	–	–	–	–	–
Dépréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	67 076 684	–	–	–	99 101	–	2 320 596
Dépréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	–	–	15 556	–	–	–	–
Total des passifs		78 359 155	11 949 835	224 668	144 903	267 580	175 950	3 235 314
TOTAL DES ACTIFS NETS		4 765 563 709	2 274 242 936	26 382 163	197 443 600	270 188 540	276 738 309	523 771 632

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des actifs nets (suite)

		State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund USD	State Street US Opportunities Equity Fund USD	State Street China Opportunities Equity Fund USD	State Street Sustainable Climate World Equity Fund USD	State Street Sustainable Climate US Equity Fund USD	State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund ^(c) USD
Au 31 décembre 2023	Notes							
ACTIFS								
Investissements en titres, à la valeur de marché	2c	357 516 474	10 254 949	6 125 387	210 143 908	17 954 056	228 133 353	51 607 684
Trésorerie et actifs liquides		2 538 926	316 180	411 756	1 778 735	4 904	80 003	180 889
Dividendes et intérêts à recevoir	2h	6 042 852	9 882	4 953	141 748	13 032	3 788 130	760 289
Montants à recevoir sur cession de titres d'investissement		1 961 756	–	–	–	–	–	–
Montants à recevoir sur cessions d'actions de fonds		–	–	–	575 172	–	167 703	–
Remboursement à recevoir du Gestionnaire financier	3b	–	142 771	–	34 912	17 490	134 799	29 426
Appréciation latente sur contrats de change à terme	2g	34 992	–	–	–	–	–	–
Appréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	–	–	–	1 799 414	–	700 850	1 484 359
Appréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	3 734	–	43 750	219
Autres actifs		18 456	670	268	420	773	–	–
Total des actifs		368 113 456	10 724 452	6 542 364	214 478 043	17 990 255	233 048 588	54 062 866
PASSIFS								
Découverts bancaires		–	–	–	–	–	–	–
Montants à payer sur achat de titres d'investissement		1 864 680	–	–	–	–	–	–
Montants à payer sur rachats d'actions		–	–	–	157 787	–	17 492	–
Charges constatées et autres passifs		48 107	36 098	38 917	62 303	43 031	54 156	31 909
Commissions dues au Gestionnaire financier	3b	28 111	74 817	4 085	29	4 484	24 788	3 806
Dépréciation latente sur contrats de change à terme	2g	19 945	–	–	–	–	–	–
Dépréciation latente sur contrats de change à terme propres à une catégorie d'actions	2g	–	–	–	1 652 855	–	225 661	484 806
Dépréciation latente sur contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	–	–	–	–
Total des passifs		1 960 843	110 915	43 002	1 872 974	47 515	322 097	520 521
TOTAL DES ACTIFS NETS		366 152 613	10 613 537	6 499 362	212 605 069	17 942 740	232 726 491	53 542 345

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

^(c) Ce Compartiment a été lancé au cours de l'exercice. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Compte de résultat consolidé

		Consolidé EUR	State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund EUR	State Street EMU Government Bond Index Fund EUR	State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund EUR	State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund EUR	State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund EUR	State Street Global Treasury Bond Index Fund USD
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023								
PRODUITS								
Intérêt	2h	464 955 039	7 120 183	3 931 901	3 305 361	18 044 084	6 825 147	37 850 037
Dividendes (nets d'impôt à la source)	2h	271 174 139	–	–	–	–	–	–
Revenus sur prêt de titres	10	7 707 341	141 743	26 857	2 765	207 061	74 827	705 019
Autres produits		1 173 450	40	551 432	–	3 821	609	15 579
Total des produits		745 009 969	7 261 966	4 510 190	3 308 126	18 254 966	6 900 583	38 570 635
CHARGES								
Commissions du Gestionnaire financier	3b	45 682 482	501 783	325 141	123 441	902 870	376 112	2 969 005
Commissions du Dépositaire, de l'Agent administratif et de transfert	3a	11 677 515	207 215	–	56 464	204 340	83 614	763 669
Honoraires professionnels		2 488 697	54 283	45 962	36 073	75 508	56 247	90 506
Taxe d'abonnement	4	416 843	–	–	–	6 591	–	–
Charges sur prêts de titres	10	1 926 724	35 409	6 678	691	51 673	18 660	176 136
Autres charges	3c	2 834 922	39 665	31 645	27 272	39 408	81 844	16 322
Renoncement, remboursement des commissions par le Gestionnaire financier	3b	(1 955 696)	–	–	(38 605)	(10 004)	(12 968)	–
Total des charges		63 071 487	838 355	409 426	205 336	1 270 386	603 509	4 015 638
RÉSULTAT NET D'INVESTISSEMENT		681 938 482	6 423 611	4 100 764	3 102 790	16 984 580	6 297 074	34 554 997

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Compte de résultat consolidé (suite)

		State Street Global Aggregate Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Canada Index Equity Fund ^(b) CAD	State Street Japan Screened Index Equity Fund JPY	State Street Switzerland Index Equity Fund CHF	State Street UK Index Equity Fund GBP	State Street US Screened Index Equity Fund USD	State Street EMU Screened Index Equity Fund EUR
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023		Notes						
PRODUITS								
Intérêt	2h	143 986 787	6 353	128 206	7 364	34 502	208 693	58 626
Dividendes (nets d'impôt à la source)	2h	478	1 000 033	440 804 582	6 082 915	4 356 696	17 478 708	7 684 930
Revenus sur prêt de titres	10	1 319 296	162 740	20 699 907	473 440	728	65 610	53 385
Autres produits		31 019	7 216	–	–	–	–	952
Total des produits		145 337 580	1 176 342	461 632 695	6 563 719	4 391 926	17 753 011	7 797 893
CHARGES								
Commissions du Gestionnaire financier	3b	4 063 442	152 300	38 615 268	474 815	255 561	2 876 370	587 996
Commissions du Dépositaire, de l'Agent administratif et de transfert	3a	1 648 212	60 868	11 757 363	177 237	86 000	398 395	163 267
Honoraires professionnels		171 717	1 601	7 124 010	37 330	36 364	73 681	69 798
Taxe d'abonnement	4	–	–	–	–	–	–	–
Charges sur prêts de titres	10	329 631	40 643	5 167 308	119 604	180	16 392	13 323
Autres charges	3c	153 922	32 496	5 489 487	47 313	28 335	102 973	62 858
Renoncement, remboursement des commissions par le Gestionnaire financier	3b	–	(40 193)	(2 802 783)	(79 532)	(43 573)	–	(116 649)
Total des charges		6 366 924	247 715	65 350 653	776 767	362 867	3 467 811	780 593
RÉSULTAT NET D'INVESTISSEMENT		138 970 656	928 627	396 282 042	5 786 952	4 029 059	14 285 200	7 017 300

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

^(b) Ce Compartiment a été liquidé au cours de l'exercice. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Compte de résultat consolidé (suite)

		State Street Europe Screened Index Equity Fund EUR	State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund USD	State Street World Screened Index Equity Fund ^(a) USD	State Street World ESG Index Equity Fund USD	State Street Global Emerging Markets Screened Index ^(a) Equity Fund USD	State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund EUR	State Street Europe Value Spotlight Fund EUR
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023		Notes						
PRODUITS								
Intérêt	2h	99 938	11 898	1 156 354	393 705	139 266	4 809 898	8 541
Dividendes (nets d'impôt à la source)	2h	20 232 143	2 545 112	78 317 866	31 837 880	13 699 364	74 078	1 144 119
Revenus sur prêt de titres	10	306 867	8 355	1 415 352	592 266	96 470	1 606	–
Autres produits		656	159 336	785	1 014	–	534	202
Total des produits		20 639 604	2 724 701	80 890 357	32 824 865	13 935 100	4 886 116	1 152 862
CHARGES								
Commissions du Gestionnaire financier	3b	1 368 224	174 559	8 546 414	995 962	1 035 401	245 344	63 846
Commissions du Dépositaire, de l'Agent administratif et de transfert	3a	282 340	–	1 127 981	511 708	468 483	113 903	53 925
Honoraires professionnels		67 935	44 496	174 546	82 338	89 539	42 823	48 777
Taxe d'abonnement	4	–	–	–	–	–	17 394	1 963
Charges sur prêts de titres	10	76 673	2 082	353 646	147 887	24 073	401	–
Autres charges	3c	106 798	38 918	415 649	438 227	122 201	31 099	22 352
Renoncement, remboursement des commissions par le Gestionnaire financier	3b	(119 653)	–	(89 369)	–	(146 488)	(26 913)	(98 793)
Total des charges		1 782 317	260 055	10 528 867	2 176 122	1 593 209	424 051	92 070
RÉSULTAT NET D'INVESTISSEMENT		18 857 287	2 464 646	70 361 490	30 648 743	12 341 891	4 462 065	1 060 792

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Compte de résultat consolidé (suite)

		State Street Eurozone Value Spotlight Fund EUR	State Street US Value Spotlight Fund USD	State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund USD	State Street Global Value Spotlight Fund EUR	State Street Multi-Factor Global ESG (a) Equity Fund USD	State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund EUR	State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund USD
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023		Notes						
PRODUITS								
Intérêt	2h	14 750	17 382	34 369	50 340	85 117	66 611	204 475
Dividendes (nets d'impôt à la source)	2h	1 280 162	417 774	2 102 406	1 604 026	5 934 083	11 595 840	7 362 557
Revenus sur prêt de titres	10	–	–	–	–	113 443	176 137	81 768
Autres produits		6 748	–	–	5	145	638	–
Total des produits		1 301 660	435 156	2 136 775	1 654 371	6 132 788	11 839 226	7 648 800
CHARGES								
Commissions du Gestionnaire financier	3b	2 474	2 321	252 175	88 480	358	1 081 736	1 642 161
Commissions du Dépositaire, de l'Agent administratif et de transfert	3a	63 472	62 069	104 023	60 679	105 642	140 943	168 856
Honoraires professionnels		42 127	32 901	50 266	52 160	51 785	63 651	50 181
Taxe d'abonnement	4	3 728	2 631	6 520	6 632	28 694	22 934	32 573
Charges sur prêts de titres	10	–	–	–	–	28 318	44 013	20 426
Autres charges	3c	–	26 087	24 361	24 071	31 063	36 590	35 854
Renoncement, remboursement des commissions par le Gestionnaire financier	3b	(66 881)	(98 683)	(121 556)	(73 902)	(262)	–	–
Total des charges		44 920	27 326	315 789	158 120	245 598	1 389 867	1 950 051
RÉSULTAT NET D'INVESTISSEMENT		1 256 740	407 830	1 820 986	1 496 251	5 887 190	10 449 359	5 698 749

(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Compte de résultat consolidé (suite)

		State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund ^(a) USD	State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund USD	State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund USD	State Street EMU ESG Screened Equity Fund EUR	State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund EUR	State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund USD	State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund USD
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023		Notes						
PRODUITS								
Intérêt	2h	27 440	965 913	437 061	9 921	5 001	81 656	43 858
Dividendes (nets d'impôt à la source)	2h	1 356 522	25 819 314	18 743 005	872 781	876 849	6 533 051	8 174 114
Revenus sur prêt de titres	10	23 596	73 455	168 864	10 017	14 470	15 716	171 358
Autres produits		14	117	–	79	6 420	8	2
Total des produits		1 407 572	26 858 799	19 348 930	892 798	902 740	6 630 431	8 389 332
CHARGES								
Commissions du Gestionnaire financier	3b	259 445	3 723 836	2 558 471	356 594	324 976	2 058 233	1 110 854
Commissions du Dépositaire, de l'Agent administratif et de transfert	3a	67 338	571 591	251 961	71 961	28 067	255 248	181 776
Honoraires professionnels		44 456	91 677	86 239	51 914	34 111	53 658	45 993
Taxe d'abonnement	4	7 935	86 995	62 433	11 953	9 066	36 023	33 760
Charges sur prêts de titres	10	5 856	18 356	42 192	2 495	3 591	3 926	42 805
Autres charges	3c	21 648	88 611	72 540	33 645	35	72 963	16 242
Renoncement, remboursement des commissions par le Gestionnaire financier	3b	(67 244)	–	–	(135 156)	(34 488)	(333)	–
Total des charges		339 434	4 581 066	3 073 836	393 406	365 358	2 479 718	1 431 430
RÉSULTAT NET D'INVESTISSEMENT		1 068 138	22 277 733	16 275 094	499 392	537 382	4 150 713	6 957 902

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Compte de résultat consolidé (suite)

		State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund USD	State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund USD	State Street Global Opportunities Equity Fund USD	State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund USD	State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund EUR
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023								
	Notes							
PRODUITS								
Intérêt	2h	32 661	63 785 472	123 949 508	40 131	135 862	8 893 941	4 234 427
Dividendes (nets d'impôt à la source)	2h	3 086 841	–	–	960 173	1 387 962	–	–
Revenus sur prêt de titres	10	64 514	1 353 326	110 993	–	–	488	15 649
Autres produits		–	84	21 675	133 635	19	58 134	95 254
Total des produits		3 184 016	65 138 882	124 082 176	1 133 939	1 523 843	8 952 563	4 345 330
CHARGES								
Commissions du Gestionnaire financier	3b	560 113	2 687 377	2 615 719	462 103	681 544	459 031	446 336
Commissions du Dépositaire, de l'Agent administratif et de transfert	3a	68 048	1 265 905	1 624 911	–	68 389	8 993	–
Honoraires professionnels		38 984	113 198	93 262	76 531	16 070	4 601	11 941
Taxe d'abonnement	4	15 495	–	–	14 376	15 482	–	–
Charges sur prêts de titres	10	16 122	338 220	27 740	–	–	122	3 904
Autres charges	3c	23 357	147 915	92 875	70 539	34 663	39 352	41 458
Renoncement, remboursement des commissions par le Gestionnaire financier	3b	(26 849)	–	–	(141 003)	–	–	–
Total des charges		695 270	4 552 615	4 454 507	482 546	816 148	512 099	503 639
RÉSULTAT NET D'INVESTISSEMENT		2 488 746	60 586 267	119 627 669	651 393	707 695	8 440 464	3 841 691

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Compte de résultat consolidé (suite)

		State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund USD	State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund USD	State Street US Opportunities Equity Fund USD	State Street China Opportunities Equity Fund USD	State Street Sustainable Climate World Equity Fund USD	State Street Sustainable Climate US Equity Fund USD	State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund ^(a) USD
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023								
	Notes							
PRODUITS								
Intérêt	2h	34 687 110	21 799 840	8 390	15 328	23 597	604	11 084 787
Dividendes (nets d'impôt à la source)	2h	–	–	84 193	126 079	1 918 063	186 486	–
Revenus sur prêt de titres	10	14 518	26 426	–	–	–	–	–
Autres produits		4 401	49 467	–	66 068	59	–	344
Total des produits		34 706 029	21 875 733	92 583	207 475	1 941 719	187 090	11 085 131
CHARGES								
Commissions du Gestionnaire financier	3b	579 090	292 608	46 599	54 037	10 343	47 596	46 485
Commissions du Dépositaire, de l'Agent administratif et de transfert	3a	492 211	–	42 018	–	171 385	39 675	63 538
Honoraires professionnels		6 842	25 136	2 713	5 963	17 447	27 794	55 417
Taxe d'abonnement	4	–	–	955	691	17 766	1 664	–
Charges sur prêts de titres	10	3 622	6 597	–	–	–	–	–
Autres charges	3c	49 624	14 194	28 736	29 859	23 384	20 998	29 982
Renoncement, remboursement des commissions par le Gestionnaire financier	3b	(44 897)	–	(65 099)	(61 564)	(96 873)	(73 597)	(64 767)
Total des charges		1 086 492	338 535	55 922	28 986	143 452	64 130	130 655
RÉSULTAT NET D'INVESTISSEMENT		33 619 537	21 537 198	36 661	178 489	1 798 267	122 960	10 954 476

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Compte de résultat consolidé (suite)

		State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund ^(c) USD
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023	Notes	
PRODUITS		
Intérêt	2h	121 334
Dividendes (nets d'impôt à la source)	2h	–
Revenus sur prêt de titres	10	–
Autres produits		–
Total des produits		<u>121 334</u>
CHARGES		
Commissions du Gestionnaire financier	3b	3 806
Commissions du Dépositaire, de l'Agent administratif et de transfert	3a	7 061
Honoraires professionnels		19 600
Taxe d'abonnement	4	–
Charges sur prêts de titres	10	–
Autres charges	3c	5 248
Renoncement, remboursement des commissions par le Gestionnaire financier	3b	(29 427)
Total des charges		<u>6 288</u>
RÉSULTAT NET D'INVESTISSEMENT		115 046

^(c) Ce Compartiment a été lancé au cours de l'exercice. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des variations des actifs nets

		Consolidé EUR	State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund EUR	State Street EMU Government Bond Index Fund EUR	State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund EUR	State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund EUR	State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund EUR	State Street Global Treasury Bond Index Fund USD
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023	Notes							
Actif net en début d'exercice/de période		25 396 200 769	538 851 820	336 236 488	90 530 581	725 484 368	409 007 337	1 509 689 125
Résultat net d'investissement		681 938 482	6 423 611	4 100 764	3 102 790	16 984 580	6 297 074	34 554 997
Plus-values/(Moins-values) nettes sur :								
Investissements	2c	256 880 754	(12 226 506)	(18 262 204)	(5 034 500)	(21 397 002)	(23 143 852)	(14 204 581)
Contrats à terme standardisés	2e	66 400 312	–	–	–	–	–	–
Devises	2d	258 707 587	–	–	(15)	436	17	62 752 576
Variation nette de l'appréciation/(dépréciation) latente sur investissements	2c	2 586 340 810	42 265 749	34 632 869	6 501 375	66 919 477	44 027 222	65 173 578
Contrats à terme standardisés	2e	11 702 305	–	–	–	–	–	–
Devises	2d	1 669 582	(43)	–	–	(1 241)	(292)	108 378
Contrats de change à terme	2g	4 153 087	–	–	–	–	–	(7 206 239)
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets résultant d'opérations		3 867 792 919	36 462 811	20 471 429	4 569 650	62 506 250	27 180 169	141 178 709
Souscriptions		11 158 397 836	257 327 510	35 251 035	8 987 652	248 383 354	57 703 117	769 645 379
Rachats		(7 722 813 609)	(181 339 981)	(126 623 000)	(35 267 936)	(180 858 553)	(182 090 705)	(415 279 028)
Distributions	7	(24 931 377)	(21 188)	(20 933)	–	(1 103 415)	(1 727 498)	(1 063 575)
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets sur transactions d'actions du fonds		3 410 652 850	75 966 341	(91 392 898)	(26 280 284)	66 421 386	(126 115 086)	353 302 776
Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets		7 278 445 769	112 429 152	(70 921 469)	(21 710 634)	128 927 636	(98 934 917)	494 481 485
Ajustement de change	8	(851 594 763)	–	–	–	–	–	–
Actif net total en fin d'exercice/de période		31 823 051 775	651 280 972	265 315 019	68 819 947	854 412 004	310 072 420	2 004 170 610

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des variations des actifs nets (suite)

		State Street Global Aggregate Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Canada Index Equity Fund ^(b) CAD	State Street Japan Screened Index Equity Fund JPY	State Street Switzerland Index Equity Fund CHF	State Street UK Index Equity Fund GBP	State Street US Screened Index Equity Fund USD	State Street EMU Screened Index Equity Fund EUR
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023	Notes							
Actif net en début d'exercice/de période		4 979 559 296	104 718 597	17 427 370 272	373 753 638	105 389 954	1 317 577 514	271 245 631
Résultat net d'investissement		138 970 656	928 627	396 282 042	5 786 952	4 029 059	14 285 200	7 017 300
Plus-values/(Moins-values) nettes sur :								
Investissements	2c	(22 401 583)	28 100 549	1 218 908 001	21 962 719	2 026 684	116 550 603	15 924 869
Contrats à terme standardisés	2e	–	(99 382)	232 354 434	561 361	434 812	(2 078 894)	195 289
Devises	2d	172 780 662	(31 281)	7 656 750	(6 959)	199 164	8 754 326	(17 031)
Variation nette de l'appréciation/(dépréciation) latente sur investissements	2c	244 425 433	(25 260 307)	3 208 470 366	(6 714 221)	142 720	221 243 915	26 165 870
Contrats à terme standardisés	2e	–	8 340	5 710 650	11 580	6 470	351 371	(590)
Devises	2d	1 363 171	(2 081)	432 663	(104)	(4 481)	(49)	1 369
Contrats de change à terme	2g	30 569 741	–	–	–	–	(5 175 100)	–
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets résultant d'opérations		565 708 080	3 644 465	5 069 814 906	21 601 328	6 834 428	353 931 372	49 287 076
Souscriptions		1 401 694 012	10 397 555	10 463 239 504	113 391 522	30 221 620	310 551 471	58 755 335
Rachats		(271 508 020)	(118 760 617)	(7 436 743 527)	(289 519 426)	(47 617 615)	(377 333 040)	(112 032 880)
Distributions	7	–	–	–	–	–	–	(196 641)
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets sur transactions d'actions du fonds		1 130 185 992	(108 363 062)	3 026 495 977	(176 127 904)	(17 395 995)	(66 781 569)	(53 474 186)
Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets		1 695 894 072	(104 718 597)	8 096 310 883	(154 526 576)	(10 561 567)	287 149 803	(4 187 110)
Ajustement de change	8	–	–	–	–	–	–	–
Actif net total en fin d'exercice/de période		6 675 453 368	–	25 523 681 155	219 227 062	94 828 387	1 604 727 317	267 058 521

(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

(b) Ce Compartiment a été liquidé au cours de l'exercice. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des variations des actifs nets (suite)

		State Street Europe Screened Index Equity Fund EUR	State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund USD	State Street World Screened Index Equity Fund ^(a) USD	State Street World ESG Index Equity Fund USD	State Street Global Emerging Markets Screened Index ^(a) Equity Fund USD	State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund EUR	State Street Europe Value Spotlight Fund EUR
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023	Notes							
Actif net en début d'exercice/de période		660 184 761	54 212 055	4 398 383 847	1 124 653 492	363 541 739	159 307 121	35 300 381
Résultat net d'investissement		18 857 287	2 464 646	70 361 490	30 648 743	12 341 891	4 462 065	1 060 792
Plus-values/(Moins-values) nettes sur :								
Investissements	2c	30 969 718	(152 350)	222 342 005	20 361 614	(6 658 639)	(25 462 108)	4 639 719
Contrats à terme standardisés	2e	2 227 998	284 196	27 808 189	2 615 414	(65 323)	30 218 876	–
Devises	2d	(627 441)	(279 734)	(4 499 429)	3 271 078	(3 957 942)	(527 904)	107 038
Variation nette de l'appréciation/(dépréciation) latente sur investissements	2c	49 040 665	898 978	689 721 994	323 324 423	44 712 257	3 364 014	(53 633)
Contrats à terme standardisés	2e	58 820	15 677	1 296 530	457 851	182 135	7 425 229	–
Devises	2d	19 267	(3 660)	97 427	56 537	20 593	(14 154)	359
Contrats de change à terme	2g	–	–	(1 922 234)	(2 188 851)	–	–	–
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets résultant d'opérations		100 546 314	3 227 753	1 005 205 972	378 546 809	46 574 972	19 466 018	5 754 275
Souscriptions		110 244 505	20 508 820	1 054 758 823	1 045 698 091	350 222 931	41 268 465	7 084 871
Rachats		(234 316 244)	(11 225 866)	(1 782 481 344)	(141 844 232)	(137 423 867)	(24 255 828)	(27 866 282)
Distributions	7	(4 305 749)	–	(3 394 435)	–	–	–	–
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets sur transactions d'actions du fonds		(128 377 488)	9 282 954	(731 116 956)	903 853 859	212 799 064	17 012 637	(20 781 411)
Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets		(27 831 174)	12 510 707	274 089 016	1 282 400 668	259 374 036	36 478 655	(15 027 136)
Ajustement de change	8	–	–	–	–	–	–	–
Actif net total en fin d'exercice/de période		632 353 587	66 722 762	4 672 472 863	2 407 054 160	622 915 775	195 785 776	20 273 245

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des variations des actifs nets (suite)

		State Street Eurozone Value Spotlight Fund EUR	State Street US Value Spotlight Fund USD	State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund USD	State Street Global Value Spotlight Fund EUR	State Street Multi-Factor Global ESG ^(a) Equity Fund USD	State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund EUR	State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund USD
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023	Notes							
Actif net en début d'exercice/de période		31 814 974	22 315 784	57 949 039	84 450 258	186 743 835	344 282 072	485 078 088
Résultat net d'investissement		1 256 740	407 830	1 820 986	1 496 251	5 887 190	10 449 359	5 698 749
Plus-values/(Moins-values) nettes sur :								
Investissements	2c	1 706 797	660 822	1 697	(5 561 523)	4 766 223	6 504 944	16 159 016
Contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	–	2 500 937	1 556 239	4 221 567
Devises	2d	(15 644)	10 360	(1 723 014)	(1 214 077)	(2 817 100)	(145 349)	(538 013)
Variation nette de l'appréciation/(dépréciation) latente sur investissements	2c	5 209 090	2 679 835	8 261 357	9 516 912	31 593 166	35 450 863	94 099 304
Contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	–	66 493	27 485	286 454
Devises	2d	392	(1 131)	351	57 616	(3 231)	7 868	7 865
Contrats de change à terme	2g	–	–	–	1 427 715	–	–	–
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets résultant d'opérations		8 157 375	3 757 716	8 361 377	5 722 894	41 993 678	53 851 409	119 934 942
Souscriptions		7 728 194	5 927 556	11 678 645	11 903 056	266 055 542	1 103 679	12 001 570
Rachats		(9 271 104)	(4 280 040)	(12 426 175)	(50 062 033)	(190 745 053)	(41 721 274)	(30 880 691)
Distributions	7	–	–	–	–	–	(19 176)	(25 494)
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets sur transactions d'actions du fonds		(1 542 910)	1 647 516	(747 530)	(38 158 977)	75 310 489	(40 636 771)	(18 904 615)
Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets		6 614 465	5 405 232	7 613 847	(32 436 083)	117 304 167	13 214 638	101 030 327
Ajustement de change	8	–	–	–	–	–	–	–
Actif net total en fin d'exercice/de période		38 429 439	27 721 016	65 562 886	52 014 175	304 048 002	357 496 710	586 108 415

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des variations des actifs nets (suite)

		State Street Sustainable Global ESG Screened Enhanced Equity Fund ^(a) USD	State Street Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund USD	State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund USD	State Street EMU ESG Screened Equity Fund EUR	State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund EUR	State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund USD	State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund USD
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023	Notes							
Actif net en début d'exercice/de période		65 815 553	617 727 630	722 388 874	25 030 438	21 081 590	136 598 739	394 061 217
Résultat net d'investissement		1 068 138	22 277 733	16 275 094	499 392	537 382	4 150 713	6 957 902
Plus-values/(Moins-values) nettes sur :								
Investissements	2c	436 073	4 625 975	18 804 438	610 995	(575 942)	7 108 579	3 970 171
Contrats à terme standardisés	2e	368 478	(3 694 324)	(821 592)	48 376	(27 717)	(169 140)	813 837
Devises	2d	(543 978)	(9 528 660)	(16 960 263)	688	(217 515)	(3 149 085)	834 117
Variation nette de l'appréciation/(dépréciation) latente sur investissements	2c	14 355 050	65 106 167	57 727 890	2 764 749	2 602 840	40 842 622	(2 922 354)
Contrats à terme standardisés	2e	28 846	634 019	1 000 741	7 680	7 635	–	96 919
Devises	2d	5 984	56 148	38 263	79	806	11 488	8 309
Contrats de change à terme	2g	–	–	–	–	–	–	(252 143)
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets résultant d'opérations		15 718 591	79 477 058	76 064 571	3 931 959	2 327 489	48 795 177	9 506 758
Souscriptions		15 129 161	263 795 289	42 270 753	3 828 810	1 095 002	53 234 246	58 544 516
Rachats		(9 975 197)	(97 816 180)	(276 148 556)	(6 205 054)	(2 640 556)	(4 588 586)	(182 821 756)
Distributions	7	(11 254)	–	246	(41 460)	(32 090)	–	(948 667)
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets sur transactions d'actions du fonds		5 142 710	165 979 109	(233 877 557)	(2 417 704)	(1 577 644)	48 645 660	(125 225 907)
Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets		20 861 301	245 456 167	(157 812 986)	1 514 255	749 845	97 440 837	(115 719 149)
Ajustement de change	8	–	–	–	–	–	–	–
Actif net total en fin d'exercice/de période		86 676 854	863 183 797	564 575 888	26 544 693	21 831 435	234 039 576	278 342 068

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des variations des actifs nets (*suite*)

		State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund USD	State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund ^(a) USD	State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund USD	State Street Global Opportunities Equity Fund USD	State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund USD	State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund EUR
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023	Notes							
Actif net en début d'exercice/de période		131 225 462	2 650 831 633	1 802 617 445	35 681 467	107 658 469	230 324 620	227 693 811
Résultat net d'investissement		2 488 746	60 586 267	119 627 669	651 393	707 695	8 440 464	3 841 691
Plus-values/(Moins-values) nettes sur :								
Investissements	2c	4 115 469	(36 809 590)	(27 841 082)	(3 890 195)	(3 271 128)	(4 712 174)	(5 147 501)
Contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	213 056	–	–	–
Devises	2d	(4 242 929)	96 038 015	(18 929 941)	(1 320 382)	(637 784)	3 692 810	42 609
Variation nette de l'appréciation/(dépréciation) latente sur investissements	2c	5 777 576	195 511 997	163 963 819	5 659 096	42 079 704	15 465 595	20 495 894
Contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	(15 696)	–	–	–
Devises	2d	6 814	446 776	(575 585)	1 955	19	185	(207)
Contrats de change à terme	2g	–	(15 059 270)	682 850	–	–	(1 612 940)	–
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets résultant d'opérations		8 145 676	300 714 195	236 927 730	1 299 227	38 878 506	21 273 940	19 232 486
Souscriptions		13 789 957	3 384 886 790	828 153 402	10 940 493	54 495 322	26 998 622	44 665 335
Rachats		(44 698 914)	(1 566 380 559)	(593 264 279)	(21 539 024)	(3 588 697)	(8 342 915)	(14 783 000)
Distributions	7	–	(4 488 350)	(191 362)	–	–	(65 727)	(70 323)
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets sur transactions d'actions du fonds		(30 908 957)	1 814 017 881	234 697 761	(10 598 531)	50 906 625	18 589 980	29 812 012
Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets		(22 763 281)	2 114 732 076	471 625 491	(9 299 304)	89 785 131	39 863 920	49 044 498
Ajustement de change	8	–	–	–	–	–	–	–
Actif net total en fin d'exercice/de période		108 462 181	4 765 563 709	2 274 242 936	26 382 163	197 443 600	270 188 540	276 738 309

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des variations des actifs nets (*suite*)

		State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund USD	State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund USD	State Street US Opportunities Equity Fund USD	State Street China Opportunities Equity Fund USD	State Street Sustainable Climate World Equity Fund USD	State Street Sustainable Climate US Equity Fund USD	State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund ^(a) USD
Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023	Notes							
Actif net en début d'exercice/de période		342 931 569	305 210 405	8 337 933	7 592 120	13 010 977	14 291 190	51 079 690
Résultat net d'investissement		33 619 537	21 537 198	36 661	178 489	1 798 267	122 960	10 954 476
Plus-values/(Moins-values) nettes sur :								
Investissements	2c	(18 081 327)	(432 112)	(388 140)	(585 457)	980 831	122 540	595 516
Contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	(20 236)	168 001	–	(97 979)
Devises	2d	(2 754 458)	1 143 188	–	(56 062)	4 672 307	(1)	320 649
Variation nette de l'appréciation/(dépréciation) latente sur investissements	2c	40 085 875	19 749 559	2 627 083	(610 274)	23 047 999	3 406 051	4 823 653
Contrats à terme standardisés	2e	–	–	–	–	3 734	–	42 836
Devises	2d	5 313	77 785	–	782	1 107	–	(54)
Contrats de change à terme	2g	3 468 521	21 690	–	–	146 559	–	475 189
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets résultant d'opérations		56 343 461	42 097 308	2 275 604	(1 092 758)	30 818 805	3 651 550	17 114 286
Souscriptions		355 469 677	46 265 042	–	–	208 843 278	–	188 027 431
Rachats		(222 352 311)	(27 420 142)	–	–	(40 067 991)	–	(23 494 916)
Distributions	7	(8 620 764)	–	–	–	–	–	–
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets sur transactions d'actions du fonds		124 496 602	18 844 900	–	–	168 775 287	–	164 532 515
Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets		180 840 063	60 942 208	2 275 604	(1 092 758)	199 594 092	3 651 550	181 646 801
Ajustement de change	8	–	–	–	–	–	–	–
Actif net total en fin d'exercice/de période		523 771 632	366 152 613	10 613 537	6 499 362	212 605 069	17 942 740	232 726 491

^(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

État consolidé des variations des actifs nets (*suite*)

		State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund ^(c) USD
<u>Pour l'exercice/la période clôturé(e) le 31 décembre 2023</u>	<u>Notes</u>	
Actif net en début d'exercice/de période		–
Résultat net d'investissement		<u>115 046</u>
Plus-values/(Moins-values) nettes sur :		
Investissements	2c	(478)
Contrats à terme standardisés	2e	(1)
Devises	2d	269
Variation nette de l'appréciation/(dépréciation) latente sur investissements	2c	15 991
Contrats à terme standardisés	2e	219
Devises	2d	511
Contrats de change à terme	2g	999 553
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets résultant d'opérations		<u>1 131 110</u>
Souscriptions		52 411 235
Rachats		–
Distributions	7	–
Augmentation/(Diminution) nette totale des actifs nets sur transactions d'actions du fonds		<u>52 411 235</u>
Augmentation/(Diminution) totale des actifs nets		53 542 345
Ajustement de change	8	<u>–</u>
Actif net total en fin d'exercice/de période		53 542 345

^(c) Ce Compartiment a été lancé au cours de l'exercice. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Les notes jointes font partie intégrante des présents états financiers.

Informations statistiques

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	286 633 825	12,52	244 367 572	10,16	243 279 118	10,78	22 568 735
Catégorie I Distribution (EUR)	EUR	15 274 326	11,40	12 380 644	9,24	15 264 329	9,77	1 561 726
Catégorie I (EUR)	EUR	318 883 764	13,55	279 468 067	10,98	390 058 831	11,63	33 528 339
Catégorie P (EUR)	EUR	3 580 590	12,27	2 635 537	9,94	2 678 694	10,51	254 929
Total des actifs nets	EUR	624 372 505		538 851 820		651 280 972		
State Street EMU Government Bond Index Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	252 991 760	13,63	114 339 520	11,10	131 850 945	11,92	11 059 386
Catégorie I (EUR)	EUR	211 118 475	13,94	178 373 948	11,34	88 108 003	12,16	7 242 885
Catégorie P Distribution (EUR)	EUR	17 413 618	11,59	10 181 941	9,40	9 358 311	10,04	932 476
Catégorie P (EUR)	EUR	72 265 818	14,78	33 341 079	12,00	35 997 760	12,85	2 801 692
Total des actifs nets	EUR	553 789 671		336 236 488		265 315 019		
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund								
Catégorie I (EUR)	EUR	116 179 764	12,89	89 568 713	11,62	68 819 947	12,30	5 596 595
Catégorie P (EUR)	EUR	1 018 391	10,43	961 868	9,39	–	–	–
Total des actifs nets	EUR	117 198 155		90 530 581		68 819 947		
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	687 801 790	13,68	190 688 929	11,83	261 312 008	12,82	20 377 237
Catégorie I Distribution (EUR)	EUR	103 802 159	10,42	78 289 527	8,90	86 238 525	9,51	9 065 351
Catégorie I (EUR)	EUR	970 780 123	15,72	438 712 831	13,57	488 333 760	14,69	33 238 843
Catégorie P Distribution (EUR)	EUR	35 116 297	10,13	12 899 872	8,66	12 691 805	9,26	1 370 789
Catégorie P (EUR)	EUR	4 209 231	12,22	4 893 209	10,53	5 835 906	11,38	513 006
Total des actifs nets	EUR	1 801 709 600		725 484 368		854 412 004		
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund								
Catégorie A2 Distribution (EUR)	EUR	559 802 090	10,65	163 377 871	9,11	201 724 338	9,77	20 649 443
Catégorie A2 (EUR)	EUR	1 951 903	11,23	510 015	9,68	–	–	–
Catégorie I Distribution (EUR)	EUR	24 069 667	11,95	1 727 313	10,23	1 911 236	10,97	174 295
Catégorie I (EUR)	EUR	396 369 406	13,77	238 863 811	11,85	101 176 186	12,82	7 893 869
Catégorie S (EUR)	EUR	3 087 271	9,90	4 528 327	8,53	5 260 660	9,24	569 197
Total des actifs nets	EUR	985 280 338		409 007 337		310 072 420		

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street Global Treasury Bond Index Fund								
Catégorie A (USD)	USD	102 732	10,27	–	–	–	–	–
Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	–	–	4 384 078	9,97	104 974 892	10,54	9 958 344
Catégorie B (USD)	USD	60 310 997	11,01	53 106 857	9,09	22 846 937	9,45	2 417 302
Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	CHF	1 412 501	10,20	4 547 497	8,84	6 618 255	9,00	735 280
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	148 217	10,09	371 553	8,69	1 397 962	8,95	156 157
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	67 057 024	10,45	73 522 678	9,13	38 292 812	9,53	4 017 543
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	USD	523 153	11,89	–	–	–	–	–
Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	120 155 939	10,84	203 938 087	9,56	294 218 992	10,08	29 199 110
Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	681 561 162	11,51	691 412 726	10,02	913 799 613	10,41	87 739 643
Catégorie I (Portefeuille couvert en SGD)	SGD	218 174 630	9,85	193 771 491	8,74	203 157 824	9,17	22 158 482
Catégorie I (USD)	USD	105 197 672	12,05	79 469 496	9,93	97 186 140	10,32	9 414 250
Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	USD	200 410 890	13,91	150 215 288	12,40	153 479 528	13,18	11 642 262
Catégorie P (USD)	USD	3 556 959	11,85	166 770	9,75	106 669	10,12	10 542
Total des actifs nets	USD	1 562 296 730		1 509 689 125		2 004 170 610		
State Street Global Aggregate Bond Index Fund ^(a)								
Catégorie A (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	114 106 047	9,83	–	–	–	–	–
Catégorie A (USD)	USD	107 850	10,79	–	–	–	–	–
Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	–	–	12 630 271	9,96	133 117 699	10,58	12 587 724
Catégorie B (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	2 155 093 609	11,05	2 363 545 053	9,72	3 099 808 163	10,31	300 800 388
Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	CHF	5 219 894	10,91	4 502 896	9,42	4 124 904	9,63	428 419
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	USD	–	–	–	–	14 080 480	10,40	1 353 969
Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	30 260 015	11,89	23 433 978	10,44	19 634 022	11,05	1 776 433
Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	395 194 064	11,36	289 011 617	9,86	253 508 870	10,29	24 640 980
Catégorie I (USD)	USD	761 805 353	11,58	535 708 027	9,69	551 259 520	10,23	53 890 998
Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	USD	1 281 250 035	12,73	1 244 028 377	11,28	1 685 484 536	12,06	139 780 167
Total des actifs nets	USD	5 588 040 880		4 979 559 296		6 675 453 368		
State Street Canada Index Equity Fund ^(b)								
Catégorie I (CAD)	CAD	48 904 273	17,99	33 254 664	16,82	–	–	–
Catégorie I (EUR)	EUR	44 101 003	16,09	28 701 405	14,94	–	–	–
Catégorie P (CAD)	CAD	32 017 736	17,55	29 959 861	16,33	–	–	–
Total des actifs nets	CAD	144 271 133		104 718 597		–		

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street Japan Screened Index Equity Fund								
Catégorie B Distribution (GBP)	GBP	–	–	–	–	40 047 479	11,00	3 641 110
Catégorie B (JPY)	JPY	1 034 298 652	15,77	912 283 626	15,05	–	–	–
Catégorie I (EUR)	EUR	49 676 654	16,04	40 634 627	14,21	40 595 058	16,48	2 463 606
Catégorie I (JPY)	JPY	13 488 718 682	15,56	10 530 548 005	14,82	11 634 705 237	19,00	612 203 289
Catégorie P (JPY)	JPY	284 999 315	15,18	262 446 420	14,40	369 576 511	18,39	20 095 989
Total des actifs nets	JPY	21 313 404 709		17 427 370 272		25 523 681 155		
State Street Switzerland Index Equity Fund								
Catégorie A (CHF)	CHF	–	–	91 340	9,18	277 436	9,63	28 803
Catégorie I (CHF)	CHF	137 183 142	17,56	95 033 185	14,53	72 494 444	15,27	4 747 617
Catégorie P (CHF)	CHF	18 254 122	17,12	16 303 681	14,12	15 167 053	14,77	1 026 722
Catégorie P (EUR)	EUR	199 337	18,04	529 386	15,61	584 037	17,34	33 674
Catégorie S (CHF)	CHF	136 627 521	15,67	261 803 054	12,99	130 745 131	13,66	9 571 222
Total des actifs nets	CHF	292 271 334		373 753 638		219 227 062		
State Street UK Index Equity Fund								
Catégorie I (EUR)	EUR	114 752 777	12,99	102 436 597	13,14	89 146 004	14,43	6 178 424
Catégorie I (GBP)	GBP	10 342 036	14,81	6 366 553	15,82	6 556 147	16,98	386 170
Catégorie P (GBP)	GBP	7 774 341	14,45	8 137 851	15,38	11 024 890	16,43	671 051
Total des actifs nets	GBP	114 463 217		105 389 954		94 828 387		
State Street US Screened Index Equity Fund								
Catégorie B Distribution (GBP)	GBP	–	–	763 311	9,99	95 616 060	11,95	7 999 804
Catégorie B (USD)	USD	242 437 701	27,05	118 862 007	21,61	62 471 445	27,38	2 281 340
Catégorie I (EUR)	EUR	523 931 977	26,25	196 590 234	22,29	267 074 628	27,25	9 800 328
Catégorie I (VNI couverte en EUR)	EUR	88 872 918	23,61	319 536 270	18,24	316 759 134	22,44	14 114 065
Catégorie I (USD)	USD	918 849 146	26,71	602 831 601	21,29	723 638 476	26,93	26 867 787
Catégorie P (USD)	USD	56 582 557	26,05	44 128 742	20,68	51 794 157	26,06	1 987 659
Total des actifs nets	USD	1 914 749 506		1 317 577 514		1 604 727 317		
State Street EMU Screened Index Equity Fund								
Catégorie A (EUR)	EUR	515 325	12,18	263 462	10,65	282 257	12,68	22 264
Catégorie B (EUR)	EUR	35 333 634	17,05	29 124 445	14,95	33 435 068	17,87	1 871 188
Catégorie I Distribution (EUR)	EUR	9 784 020	12,71	8 183 596	10,91	8 472 786	12,71	666 558
Catégorie I (EUR)	EUR	289 973 768	16,83	174 915 761	14,73	201 039 006	17,57	11 441 172
Catégorie P (EUR)	EUR	66 475 856	16,40	58 758 367	14,29	23 829 404	16,97	1 404 286
Total des actifs nets	EUR	402 082 603		271 245 631		267 058 521		

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street Europe Screened Index Equity Fund								
Catégorie B Distribution (GBP)	GBP	–	–	10 286 049	9,88	18 628 766	11,23	1 659 445
Catégorie B (EUR)	EUR	57 328 857	15,50	37 939 043	13,90	15 996 887	16,17	989 029
Catégorie I Distribution (EUR)	EUR	177 830 504	14,41	155 695 379	12,62	176 308 167	14,29	12 341 594
Catégorie I (EUR)	EUR	607 655 496	16,22	412 499 967	14,52	374 280 545	16,86	22 194 689
Catégorie P (EUR)	EUR	48 902 978	15,81	42 456 732	14,09	44 269 858	16,30	2 716 459
Total des actifs nets	EUR	891 896 213		660 184 761		632 353 587		
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund								
Catégorie B Distribution (GBP)	GBP	–	–	–	–	12 289 596	10,10	1 216 888
Catégorie B (USD)	USD	4 208 889	17,27	3 646 365	15,85	–	–	–
Catégorie I (EUR)	EUR	27 855 386	13,02	22 328 000	12,70	21 627 572	12,92	1 674 557
Catégorie I (USD)	USD	19 926 810	17,05	7 479 349	15,62	7 697 607	16,43	468 376
Catégorie P (USD)	USD	22 493 129	16,63	19 256 637	15,17	19 467 494	15,90	1 224 146
Total des actifs nets	USD	78 305 800		54 212 055		66 722 762		
State Street World Screened Index Equity Fund^(a)								
Catégorie B Distribution (GBP)	GBP	–	–	–	–	40 807 480	11,15	3 660 061
Catégorie B (GBP)	GBP	532 658 080	13,75	–	–	–	–	–
Catégorie B (Distribution couverte en GBP)	GBP	–	–	–	–	80 941 117	12,27	6 594 035
Catégorie B (USD)	USD	1 467 678 053	22,80	372 612 567	18,58	443 241 429	23,06	19 218 965
Catégorie B (Portefeuille couvert en USD)	USD	147 250 239	21,71	106 787 273	18,28	113 414 689	22,78	4 977 804
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en CHF)	USD	43 833 817	10,65	44 492 791	8,60	10 898 319	10,07	1 082 740
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	USD	–	–	2 054 786	10,12	2 192 327	12,23	179 274
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	USD	3 791 449	10,74	5 042 545	8,79	1 985 949	10,63	186 813
Catégorie I Distribution (USD)	USD	–	–	–	–	75 779 230	10,87	6 970 515
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	USD	31 148 377	10,73	27 441 322	8,97	2 707 445	11,00	246 218
Catégorie I (EUR)	EUR	927 093 607	22,12	872 282 744	19,17	806 889 114	22,94	35 169 141
Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	173 900 654	14,75	140 103 388	12,03	139 514 934	14,57	9 575 822
Catégorie I (GBP)	GBP	101 092 841	16,10	90 263 027	14,74	108 811 845	17,23	6 313 460
Catégorie I (SEK)	SEK	1 442 659 613	108,15	1 659 188 598	101,21	527 596 775	121,27	4 350 496
Catégorie I (Portefeuille couvert en SEK)	SEK	1 697 043 055	113,26	1 557 799 592	91,99	841 394 725	111,13	7 571 095
Catégorie I (USD)	USD	2 307 075 928	22,52	1 644 606 174	18,30	1 632 204 458	22,67	71 987 906
Catégorie P (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	66 261 990	20,12	55 245 252	16,36	27 485 560	19,73	1 392 880
Catégorie P (SEK)	USD	1 856 288	111,37	32 754 419	103,78	72 667 971	123,85	586 729
Catégorie P (Portefeuille couvert en SEK)	USD	3 263 055	107,01	102 408 931	86,64	170 630 753	104,26	1 636 614
Catégorie P (USD)	USD	189 692 163	21,95	169 314 869	17,77	184 029 615	21,93	8 391 454

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street World Screened Index Equity Fund ^(a) (suite)								
Catégorie S Distribution (USD)	USD	88 903 714	14,86	132 316 841	11,94	200 686 105	14,58	13 761 945
Catégorie S (USD)	USD	318 294 921	14,94	319 233 776	12,17	474 667 654	15,10	31 442 678
Total des actifs nets	USD	7 137 139 092		4 398 383 847		4 672 472 863		
State Street World ESG Index Equity Fund								
Catégorie B (USD)	USD	265 307 535	24,28	819 934 513	19,75	1 727 812 907	24,49	70 545 738
Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	159 290 387	14,61	100 348 615	11,95	123 537 473	14,45	8 552 147
Catégorie I (USD)	USD	169 774 998	22,84	197 621 297	18,54	542 775 093	22,95	23 651 172
Total des actifs nets	USD	616 227 105		1 124 653 492		2 407 054 160		
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund ^(a)								
Catégorie B Distribution (GBP)	GBP	–	–	–	–	74 384 469	10,51	7 079 718
Catégorie B (USD)	USD	129 304 730	18,10	182 378 669	14,30	360 894 353	15,74	22 931 178
Catégorie I (GBP)	GBP	11 013 476	10,15	10 529 177	9,00	11 113 688	9,32	1 192 264
Catégorie I (SEK)	USD	832 323 447	98,29	657 827 704	89,13	497 043 918	94,57	5 255 803
Catégorie I (USD)	USD	102 696 773	17,76	58 890 308	13,99	66 176 535	15,35	4 310 822
Catégorie P (USD)	USD	57 590 856	16,76	46 472 536	13,08	38 653 199	14,21	2 719 761
Total des actifs nets	USD	396 439 935		363 541 739		622 915 775		
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	138 315 113	13,05	125 252 332	11,63	158 470 324	13,02	12 170 633
Catégorie I (EUR)	EUR	24 562 704	12,53	25 219 700	11,11	28 125 356	12,37	2 273 192
Catégorie P (EUR)	EUR	10 721 117	12,10	8 835 089	10,67	9 190 096	11,80	778 625
Total des actifs nets	EUR	173 598 934		159 307 121		195 785 776		
State Street Europe Value Spotlight Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	19 804 758	16,39	17 001 766	15,91	20 059 357	19,27	1 041 100
Catégorie I (EUR)	EUR	19 908 030	11,38	18 278 870	10,97	210 438	13,17	15 975
Catégorie P (EUR)	EUR	35 062	14,35	19 745	13,72	3 450	16,35	211
Total des actifs nets	EUR	39 747 849		35 300 381		20 273 245		
State Street Eurozone Value Spotlight Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	58 855 618	19,38	31 524 777	18,53	38 025 704	23,38	1 626 115
Catégorie I (EUR)	EUR	14 833 741	16,34	168 830	15,55	215 970	19,47	11 090
Catégorie P (EUR)	EUR	184 399	16,45	121 367	15,49	187 765	19,25	9 753
Total des actifs nets	EUR	73 873 758		31 814 974		38 429 439		

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street US Value Spotlight Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	18 809 972	18,80	20 542 429	19,57	24 927 041	21,99	1 133 449
Catégorie I (USD)	USD	165 656	16,57	391 830	16,06	185 382	18,54	10 000
Total des actifs nets	USD	21 556 359		22 315 784		27 721 016		
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	26 828 093	17,69	26 730 774	17,96	26 569 532	19,93	1 332 942
Catégorie B (USD)	USD	26 828 093	17,69	–	–	–	–	–
Catégorie I (USD)	USD	11 736 377	15,76	29 420 441	14,91	36 212 789	17,00	2 129 861
Total des actifs nets	USD	42 245 374		57 949 039		65 562 886		
State Street Global Value Spotlight Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	127 532 835	24,35	71 732 094	24,18	47 529 568	26,67	1 782 157
Catégorie I (EUR)	EUR	4 730 150	20,00	1 377	19,67	253 267	21,53	11 761
Catégorie I (USD)	USD	2 288 891	9,54	13 022 939	8,82	4 094 006	10,00	409 528
Catégorie P (EUR)	EUR	506 516	19,22	514 556	18,79	525 183	20,41	25 733
Total des actifs nets	EUR	134 782 248		84 450 258		52 014 175		
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund^(a)								
Catégorie B Distribution (GBP)	GBP	–	–	205 315	9,97	166 913 766	11,20	14 896 764
Catégorie B (USD)	USD	208 259 845	16,64	186 392 498	13,49	91 280 363	16,06	5 682 504
Catégorie I (USD)	USD	17 341 174	18,10	104 771	14,61	106 935	17,33	6 169
Total des actifs nets	USD	225 601 019		186 743 835		304 048 002		
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund								
Catégorie I (EUR)	EUR	421 426 452	15,98	336 027 783	14,38	348 586 417	16,70	20 872 725
Catégorie P (EUR)	EUR	9 750 818	13,93	8 254 289	12,50	8 910 293	14,48	615 178
Total des actifs nets	EUR	431 177 303		344 282 072		357 496 710		
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund								
Catégorie I (USD)	USD	593 209 343	23,69	482 845 887	19,28	584 220 542	24,01	24 329 256
Catégorie P (USD)	USD	57 596 616	23,29	2 232 201	18,92	1 887 873	23,51	80 316
Total des actifs nets	USD	650 805 959		485 078 088		586 108 415		

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund ^(a)								
Catégorie I Distribution (USD)	USD	1 286 185	18,56	845 727	15,12	314 478	18,46	17 035
Catégorie I (USD)	USD	85 131 183	20,41	64 969 826	16,83	86 405 715	20,84	4 146 619
Total des actifs nets	USD	86 417 368		65 815 553		86 676 854		
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund								
Catégorie I (EUR)	EUR	71 417 631	12,21	106 740 545	10,30	184 471 537	11,08	16 645 000
Catégorie I (USD)	USD	1 487 000 499	15,66	503 810 166	12,40	659 406 929	13,81	47 764 536
Catégorie P (USD)	USD	118 169	11,82	–	–	–	–	–
Total des actifs nets	USD	1 568 334 919		617 727 630		863 183 797		
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund								
Catégorie B (GBP)	GBP	69 836 781	11,72	25 158 930	10,55	23 867 646	11,34	2 104 156
Catégorie B (USD)	USD	18 138 291	18,73	610 407	14,97	–	–	–
Catégorie I (EUR)	EUR	318 742 877	17,26	240 909 048	14,63	38 163 698	16,04	2 379 832
Catégorie I (USD)	USD	848 404 096	17,83	430 045 937	14,19	483 541 638	16,09	30 048 879
Catégorie P (EUR)	EUR	4 533 410	12,68	3 597 465	10,69	7 120 433	11,65	611 018
Catégorie P (USD)	USD	654 650	17,06	518 205	13,51	584 654	15,24	38 370
Total des actifs nets	USD	1 329 417 917		722 388 874		564 575 888		
State Street EMU ESG Screened Equity Fund								
Catégorie I (EUR)	EUR	1 520 673	36,45	4 476 427	31,43	2 078 615	37,11	56 017
Catégorie P Distribution (EUR)	EUR	2 856 687	13,76	2 199 572	11,62	2 242 508	13,34	168 079
Catégorie P (EUR)	EUR	33 490 587	14,12	18 354 439	12,05	22 223 570	14,08	1 578 314
Total des actifs nets	EUR	37 867 947		25 030 438		26 544 693		
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund								
Catégorie P Distribution (EUR)	EUR	1 397 226	13,76	1 065 712	11,14	1 121 374	12,07	92 874
Catégorie P (EUR)	EUR	27 813 488	15,77	20 015 878	12,98	20 710 061	14,47	1 431 490
Total des actifs nets	EUR	29 210 714		21 081 590		21 831 435		

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund								
Catégorie A (USD)	USD	3 632 720	14,40	16 099 821	12,15	29 650 737	15,96	1 857 677
Catégorie I (EUR)	EUR	8 937 860	14,21	1 795 481	12,79	6 295 073	16,26	387 051
Catégorie I (USD)	USD	322 818 986	17,92	105 210 288	15,14	172 594 317	19,92	8 665 474
Catégorie P (USD)	USD	195 321	14,12	13 372 427	11,80	24 840 643	15,34	1 618 857
Total des actifs nets	USD	336 811 208		136 598 739		234 039 576		
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund								
Catégorie A (USD)	USD	3 300 948	16,22	2 878 010	15,56	779 955	15,93	48 953
Catégorie B (USD)	USD	34 223 292	24,64	48 754 891	23,75	27 627 098	24,44	1 130 304
Catégorie I Distribution (EUR)	EUR	31 602 886	13,91	59 103 114	14,05	26 160 945	13,69	1 911 246
Catégorie I (EUR)	EUR	65 968 769	18,51	65 341 481	18,95	71 599 068	18,77	3 813 857
Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	USD	44 316 885	10,47	123 234 501	10,13	120 633 427	10,22	11 804 009
Catégorie I (USD)	USD	69 021 158	29,15	76 938 021	28,01	7 914 847	28,72	275 563
Catégorie P (USD)	USD	871 554	19,61	1 154 808	18,75	772 132	19,11	40 412
Total des actifs nets	USD	268 772 750		394 061 217		278 342 068		
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	202 640 834	12,55	45 295 541	12,26	37 151 706	12,75	2 913 951
Catégorie B (USD)	USD	6 065 265	16,19	5 681 186	14,83	–	–	–
Catégorie I (USD)	USD	70 715 875	16,46	77 202 572	14,97	67 422 596	16,00	4 213 632
Total des actifs nets	USD	307 223 635		131 225 462		108 462 181		
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund^(a)								
Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	CHF	409 729 325	9,77	390 892 440	8,96	191 188 007	9,10	21 008 978
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	25 078 383	9,79	23 184 018	8,97	22 281 455	9,23	2 412 927
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	49 525 681	9,98	89 722 806	9,28	2 163 268 834	9,68	223 565 949
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	USD	124 314 514	10,11	137 083 124	9,47	115 331 268	9,95	11 586 513
Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	1 241 380 484	9,85	1 285 310 983	9,07	1 084 700 416	9,40	115 351 938
Catégorie I (USD)	USD	1 569 595	10,10	2 071 959	8,85	255 276	9,20	27 755
Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	USD	533 139 893	10,14	584 762 518	9,54	444 161 316	10,10	43 960 073
Total des actifs nets	USD	2 616 007 765		2 650 831 633		4 765 563 709		

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund^(a)								
Catégorie B Distribution (GBP)	GBP	–	–	37 531	10,01	67 551 512	10,67	6 331 925
Catégorie B (USD)	USD	136 462 831	9,62	111 704 312	8,52	136 729 986	9,62	14 214 481
Catégorie I Distribution (USD)	USD	3 259 286	9,26	3 902 230	7,86	4 010 042	8,45	474 664
Catégorie I (EUR)	EUR	1 175 004 717	9,41	1 287 649 297	8,86	1 285 761 821	9,66	133 166 429
Catégorie I (USD)	USD	258 610 259	9,76	312 715 642	8,63	628 900 969	9,73	64 613 881
Total des actifs nets	USD	1 734 537 371		1 802 617 445		2 274 242 936		
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund								
Catégorie I (EUR)	EUR	15 744 671	12,44	8 401 423	10,22	–	–	–
Catégorie I (USD)	USD	6 369 490	12,60	100 286	9,71	109 374	10,59	10 325
Catégorie P (EUR)	EUR	31 531 663	9,87	23 922 444	8,06	22 812 012	8,44	2 704 063
Catégorie P (USD)	USD	1 470 204	9,92	1 083 710	7,60	1 073 449	8,24	130 289
Total des actifs nets	USD	61 602 525		35 681 467		26 382 163		
State Street Global Opportunities Equity Fund								
Catégorie B (USD)	USD	3 426 624	9,79	3 336 251	7,68	–	–	–
Catégorie I (USD)	USD	111 825 945	14,12	104 322 218	11,04	197 443 600	14,60	13 525 395
Total des actifs nets	USD	115 252 569		107 658 469		197 443 600		
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund								
Catégorie I (USD)	USD	32 399 124	10,26	26 827 245	8,64	22 326 577	9,36	2 384 416
Catégorie I (couverte en EUR)	EUR	18 434 721	10,01	89 013 124	8,21	118 079 913	8,67	13 624 710
Catégorie P (USD)	USD	341 439	9,99	248 684	8,40	–	–	–
Catégorie S (USD)	USD	128 263 245	10,26	108 249 805	8,65	117 424 569	9,38	12 524 213
Total des actifs nets	USD	181 967 788		230 324 620		270 188 540		
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund								
Catégorie B (EUR)	EUR	–	–	5 619 894	9,04	38 561 863	9,79	3 940 379
Catégorie I Distribution (EUR)	EUR	–	–	5 210 162	9,05	5 495 513	9,73	565 058
Catégorie I (EUR)	EUR	79 850 303	10,00	81 974 412	8,59	99 243 169	9,28	10 688 619
Catégorie P (EUR)	EUR	48 776 674	9,94	27 337 597	8,52	17 041 179	9,18	1 856 248
Catégorie S (EUR)	EUR	125 117 311	10,01	107 551 746	8,60	116 396 585	9,30	12 521 032
Total des actifs nets	EUR	253 717 417		227 693 811		276 738 309		

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund								
Catégorie B (Portefeuille couvert en EUR)	USD	13 640 544	10,00	26 855 636	8,64	41 502 624	9,56	4 343 414
Catégorie B (USD)	USD	96 855 432	10,03	100 490 900	8,70	84 013 140	9,89	8 496 843
Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	CHF	88 810 872	9,98	76 178 746	8,58	72 812 083	9,28	7 845 707
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	1 868 355	9,96	20 928 390	8,48	116 386 509	8,98	12 955 298
Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	EUR	15 799 916	9,98	15 184 030	8,61	28 369 931	9,51	2 983 137
Catégorie I (Portefeuille couvert en NOK)	USD	479 489 378	100,99	718 829 151	87,70	473 779 517	97,29	4 869 941
Catégorie I (USD)	USD	99 044	9,90	85 790	8,58	74 048 414	9,74	7 603 300
Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	USD	24 597 686	10,04	17 005 174	8,88	6 993 754	10,04	696 846
Total des actifs nets	USD	309 408 128		342 931 569		523 771 632		
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund								
Catégorie B (USD)	USD	–	–	123 728 057	10,08	124 633 710	11,51	10 827 060
Catégorie I (USD)	USD	98 747 402	10,07	181 482 348	8,90	241 518 903	10,15	23 794 119
Total des actifs nets	USD	98 747 402		305 210 405		366 152 613		
State Street US Opportunities Equity Fund								
Catégorie I (USD)	USD	–	–	8 337 933	8,34	10 613 537	10,61	1 000 000
Total des actifs nets	USD	–		8 337 933		10 613 537		
State Street China Opportunities Equity Fund								
Catégorie I (USD)	USD	–	–	7 592 120	7,59	6 499 362	6,50	1 000 000
Total des actifs nets	USD	–		7 592 120		6 499 362		
State Street Sustainable Climate World Equity Fund								
Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	–	–	–	–	166 683 067	12,24	13 617 675
Catégorie I (USD)	USD	–	–	13 010 977	8,67	117 463	10,68	11 000
Total des actifs nets	USD	–		13 010 977		212 605 069		
State Street Sustainable Climate US Equity Fund								
Catégorie I (USD)	USD	–	–	14 291 190	9,86	17 942 740	12,37	1 450 000
Total des actifs nets	USD	–		14 291 190		17 942 740		

Informations statistiques (suite)

		31 décembre 2021		31 décembre 2022		31 décembre 2023		Actions en circulation
		VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	VNI totale	VNI par Action	
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund ^(a)								
Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	GBP	–	–	–	–	72 142 385	10,80	6 682 697
Catégorie B (USD)	USD	–	–	50 977 990	10,97	84 562 446	12,26	6 897 813
Catégorie I (USD)	USD	–	–	101 700	10,97	57 593 415	12,28	4 691 740
Total des actifs nets	USD	–		51 079 690		232 726 491		
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund ^(c)								
Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	CHF	–	–	–	–	32 407 452	10,00	3 240 000
Catégorie I (USD)	USD	–	–	–	–	15 037 808	10,03	1 500 000
Total des actifs nets	USD	–		–		53 542 345		

(a) Compartiment soumis à l'ajustement de *swing pricing*. Veuillez vous référer à la Note 2K.

(b) Ce Compartiment a été liquidé au cours de l'exercice. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

(c) Ce Compartiment a été lancé au cours de l'exercice. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
Obligations d'État – 99,01 %				Obligations d'État – 99,01 % (suite)			
France				France (suite)			
4 750 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/25	4 596 005	0,71	6 530 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/36	5 525 360	0,85
7 345 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/03/25	7 094 389	1,09	2 245 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/38	1 827 340	0,28
7 470 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/25	7 248 514	1,11	4 335 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/10/38	4 959 197	0,76
3 165 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 6.000%, 25/10/25	3 358 476	0,52	4 995 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.750%, 25/06/39	4 344 301	0,67
6 045 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/11/25	5 885 170	0,90	3 540 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/40	2 452 123	0,38
5 785 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/26	5 502 576	0,84	5 465 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.500%, 25/04/41	6 665 169	1,02
6 370 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/04/26	6 532 562	1,00	2 750 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 25/05/43	2 559 700	0,39
8 035 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/26	7 694 718	1,18	3 095 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/06/44	1 939 884	0,30
7 420 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 24/09/26	7 451 090	1,14	4 175 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.250%, 25/05/45	4 357 740	0,67
5 890 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.250%, 25/11/26	5 563 223	0,85	3 990 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.000%, 25/05/48	3 301 486	0,51
5 755 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/27	5 366 825	0,82	4 590 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.500%, 25/05/50	3 335 783	0,51
5 690 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/05/27	5 461 888	0,84	5 215 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/52	2 991 376	0,46
9 155 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.750%, 25/10/27	9 325 466	1,43	5 980 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/53	3 359 444	0,52
6 840 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/02/28	6 445 674	0,99	3 160 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.000%, 25/05/54	3 105 364	0,48
9 550 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/28	8 969 455	1,38	3 565 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/04/55	4 213 010	0,65
8 375 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/11/28	7 810 106	1,20	3 185 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/04/60	3 815 184	0,59
5 635 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 5.500%, 25/04/29	6 532 092	1,00	2 475 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.750%, 25/05/66	1 772 496	0,27
7 390 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/29	6 746 848	1,04	255 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/72	106 998	0,02
6 180 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/29	5 422 579	0,83	4 935 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.750%, perpetual	5 053 884	0,78
10 300 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 25/05/30	10 431 119	1,60	5 180 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.000%, perpetual	5 388 806	0,83
9 300 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/30	7 952 895	1,22	France – Total		258 424 544	39,68
8 670 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.500%, 25/05/31	8 185 260	1,26	Allemagne			
7 905 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/31	6 565 735	1,01	4 780 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 11/04/25	4 618 149	0,71
5 175 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/05/32	4 232 995	0,65	5 800 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/10/25	5 561 620	0,85
4 975 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 5.750%, 25/10/32	6 252 680	0,96	1 725 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/10/25	1 659 295	0,26
7 475 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.000%, 25/11/32	7 199 247	1,10	5 140 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/04/26	4 892 098	0,75
2 185 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/11/33	2 363 056	0,36	5 325 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 09/10/26	5 025 788	0,77
6 485 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/34	5 699 796	0,87	3 095 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 16/04/27	2 899 025	0,45
4 535 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.750%, 25/04/35	5 459 460	0,84	5 650 000 EUR	Bundesobligation, 1.300%, 15/10/27	5 516 716	0,85

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 99,01 % (suite)				Obligations d'État – 99,01 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
775 000 EUR	Bundesobligation, 1.300%, 15/10/27	758 593	0,12	4 955 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.700%, 15/08/32	4 851 391	0,75
5 470 000 EUR	Bundesobligation, 2.200%, 13/04/28	5 522 457	0,85	6 125 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.300%, 15/02/33	6 280 514	0,97
6 150 000 EUR	Bundesobligation, 2.400%, 19/10/28	6 277 612	0,96	6 280 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.600%, 15/08/33	6 593 435	1,01
6 625 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/25	6 453 744	0,99	4 195 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/34	5 248 994	0,81
5 015 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.000%, 15/08/25	4 894 289	0,75	4 405 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/05/35	3 471 228	0,53
6 170 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/26	5 945 597	0,91	4 710 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/05/36	3 613 135	0,56
5 990 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/26	5 670 613	0,87	5 805 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.000%, 04/01/37	6 987 711	1,07
5 565 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/27	5 270 333	0,81	4 310 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.000%, 15/05/38	3 665 784	0,56
2 335 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.500%, 04/07/27	2 683 172	0,41	4 270 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.250%, 04/07/39	5 376 741	0,83
6 200 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/08/27	5 886 218	0,90	3 980 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/40	5 329 777	0,82
4 180 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/27	3 877 034	0,60	3 330 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 3.250%, 04/07/42	3 807 289	0,59
2 535 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.625%, 04/01/28	2 888 962	0,44	5 535 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.500%, 04/07/44	5 724 684	0,88
5 470 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/28	5 166 798	0,79	5 970 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.500%, 15/08/46	6 204 143	0,95
2 345 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/28	2 626 236	0,40	6 680 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.250%, 15/08/48	5 429 103	0,83
5 485 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/08/28	5 091 780	0,78	7 505 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/50	4 186 439	0,64
5 800 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/28	5 293 718	0,81	2 310 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/50	1 294 524	0,20
5 465 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/29	5 037 090	0,77	6 130 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/52	3 270 907	0,50
5 305 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/29	4 780 707	0,73	4 510 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.800%, 15/08/53	4 071 222	0,63
3 855 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.100%, 15/11/29	3 893 974	0,60	620 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.800%, 15/08/53	561 218	0,09
2 295 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.250%, 04/01/30	2 852 111	0,44	405 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.300%, perpetual	415 538	0,06
5 100 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/30	4 547 364	0,70	1 535 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.200%, 12/12/24	1 522 827	0,23
7 345 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/30	6 493 568	1,00	4 215 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.500%, 13/03/25	4 198 857	0,65
1 400 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/30	1 238 930	0,19	2 115 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 3.100%, 18/09/25	2 135 389	0,33
1 470 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.400%, 15/11/30	1 513 659	0,23	1 970 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 3.100%, 12/12/25	1 996 024	0,31
3 750 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.500%, 04/01/31	4 621 763	0,71	4 105 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.800%, perpetual	4 112 841	0,63
5 910 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/31	5 169 300	0,79	Allemagne – Total		257 439 212	39,53
6 630 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/31	5 740 585	0,88				
1 235 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/31	1 069 757	0,16				
6 605 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/32	5 650 842	0,87				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 99,01 % (suite)			
Pays-Bas			
8 005 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/25	7 731 069	1,19
5 955 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/26	5 674 758	0,87
6 605 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/26	6 327 854	0,97
7 230 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/27	6 773 570	1,04
7 530 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/27	7 181 060	1,10
4 680 000 EUR	Netherlands Government Bond, 5.500%, 15/01/28	5 277 776	0,81
8 030 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/28	7 558 960	1,16
6 225 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/29	5 599 014	0,86
5 055 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/29	4 566 333	0,70
5 230 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/30	4 551 251	0,70
5 070 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/31	4 305 038	0,66
5 610 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/32	4 843 562	0,74
6 685 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/01/33	6 804 661	1,04
4 915 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/07/33	4 987 742	0,77
7 115 000 EUR	Netherlands Government Bond, 4.000%, 15/01/37	8 304 415	1,27
4 210 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/38	2 980 301	0,46
6 690 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/01/40	4 959 765	0,76
8 040 000 EUR	Netherlands Government Bond, 3.750%, 15/01/42	9 485 994	1,46
1 145 000 EUR	Netherlands Government Bond, 3.250%, 15/01/44	1 275 049	0,20
9 040 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.750%, 15/01/47	9 479 977	1,46
6 950 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/52	3 583 420	0,55
3 520 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.000%, 15/01/54	3 179 018	0,49
3 465 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, perpetual	3 531 043	0,54
Pays-Bas – Total		128 961 630	19,80
Total des obligations d'État		644 825 386	99,01
Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
		644 825 386	99,01
TOTAL DES INVESTISSEMENTS		644 825 386	99,01
Autres actifs/(passifs) nets		6 455 586	0,99
TOTAL DES ACTIFS NETS		651 280 972	100,00

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Obligations d'État – 98,80 %				Obligations d'État – 98,80 % (<i>suite</i>)			
Autriche				Belgique			
180 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/04/25	173 520	0,06	805 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/25	783 104	0,29
430 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.200%, 20/10/25	419 895	0,16	272 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.500%, 28/03/26	283 886	0,11
357 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 4.850%, 15/03/26	374 493	0,14	465 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.000%, 22/06/26	449 888	0,17
775 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/10/26	740 908	0,28	915 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/27	870 897	0,33
400 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.500%, 20/04/27	377 000	0,14	1 422 360 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 5.500%, 28/03/28	1 607 153	0,60
647 050 EUR	Republic of Austria Government Bond, 6.250%, 15/07/27	731 367	0,28	450 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/28	423 009	0,16
640 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/02/28	600 512	0,23	430 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.900%, 22/06/29	399 642	0,15
50 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/10/28	44 718	0,02	90 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.100%, 22/06/30	77 985	0,03
480 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.500%, 20/02/29	437 616	0,16	635 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.000%, 22/06/31	573 278	0,22
970 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/02/30	837 013	0,32	680 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.010%, 22/10/31	562 020	0,21
80 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.450%, 20/10/30	84 751	0,03	704 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.000%, 28/03/32	781 792	0,29
380 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/02/31	318 592	0,12	650 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.350%, 22/06/32	542 880	0,20
820 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.900%, 20/02/32	719 714	0,27	720 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.000%, 22/06/33	743 040	0,28
560 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.900%, 20/02/33	573 048	0,22	515 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.000%, 22/06/34	529 626	0,20
235 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.400%, 23/05/34	229 360	0,09	1 077 435 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 5.000%, 28/03/35	1 309 838	0,49
791 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 4.150%, 15/03/37	901 487	0,34	245 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.900%, 22/06/38	215 992	0,08
175 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.150%, 20/06/44	181 265	0,07	370 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 2.750%, 22/04/39	360 935	0,14
820 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.500%, 20/02/47	624 676	0,23	815 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.250%, 28/03/41	951 512	0,36
130 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.850%, 23/05/49	105 391	0,04	545 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.750%, 22/06/45	602 116	0,23
550 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/03/51	332 585	0,12	400 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.600%, 22/06/47	300 760	0,11
10 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.150%, 20/10/53	10 429	0,00	700 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.700%, 22/06/50	521 094	0,20
250 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.800%, 26/01/62	296 325	0,11	550 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.400%, 22/06/53	368 390	0,14
120 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.500%, 02/11/86	73 512	0,03	310 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.300%, 22/06/54	315 983	0,12
305 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.100%, 20/09/17	241 590	0,09	440 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 2.250%, 22/06/57	360 316	0,14
40 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.850%, 30/06/20	18 604	0,01	210 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 2.150%, 22/06/66	165 312	0,06
Autriche – Total		9 448 371	3,56	60 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.650%, 22/06/71	26 664	0,01
				Belgique – Total		14 127 112	5,32

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,80 % (suite)				Obligations d'État – 98,80 % (suite)			
Finlande				France (suite)			
185 000 EUR	Finland Government Bond, 4.000%, 04/07/25	188 278	0,07	1 430 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 24/09/26	1 435 434	0,54
250 000 EUR	Finland Government Bond, 0.875%, 15/09/25	242 890	0,09	1 165 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.250%, 25/11/26	1 099 877	0,41
65 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/04/26	62 196	0,02	1 610 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/27	1 500 681	0,57
230 000 EUR	Finland Government Bond, 0.010%, 15/09/26	215 653	0,08	1 740 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/05/27	1 669 530	0,63
250 000 EUR	Finland Government Bond, 1.375%, 15/04/27	242 280	0,09	2 410 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.750%, 25/10/27	2 453 621	0,92
390 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/27	365 793	0,14	1 770 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/02/28	1 667 163	0,63
135 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/28	124 006	0,05	2 475 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/28	2 323 530	0,88
180 000 EUR	Finland Government Bond, 2.875%, 15/04/29	184 698	0,07	1 970 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/11/28	1 836 237	0,69
400 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/29	361 256	0,14	2 010 781 EUR	French Republic Government Bond OAT, 5.500%, 25/04/29	2 328 484	0,88
560 000 EUR	Finland Government Bond, 0.010%, 15/09/30	477 495	0,18	1 775 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/29	1 619 687	0,61
165 000 EUR	Finland Government Bond, 0.750%, 15/04/31	146 756	0,05	2 090 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/29	1 832 512	0,69
55 000 EUR	Finland Government Bond, 1.500%, 15/09/32	50 638	0,02	2 330 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 25/05/30	2 358 426	0,89
330 000 EUR	Finland Government Bond, 3.000%, 15/09/33	341 530	0,13	1 770 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/30	1 512 642	0,57
420 000 EUR	Finland Government Bond, 1.125%, 15/04/34	364 413	0,14	2 240 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.500%, 25/05/31	2 113 440	0,80
95 000 EUR	Finland Government Bond, 0.125%, 15/04/36	69 320	0,03	2 130 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/31	1 767 687	0,67
20 000 EUR	Finland Government Bond, 2.750%, 15/04/38	19 892	0,01	1 140 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/05/32	931 722	0,35
300 000 EUR	Finland Government Bond, 2.625%, 04/07/42	291 465	0,11	2 118 385 EUR	French Republic Government Bond OAT, 5.750%, 25/10/32	2 659 632	1,00
510 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/04/43	333 066	0,12	1 410 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.000%, 25/11/32	1 356 702	0,51
225 000 EUR	Finland Government Bond, 0.125%, 15/04/52	110 506	0,04	220 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/11/33	237 754	0,09
Finlande – Total		4 192 131	1,58	2 035 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/34	1 786 526	0,67
France				1 428 303 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.750%, 25/04/35	1 717 677	0,65
830 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/25	803 025	0,30	1 535 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/36	1 297 689	0,49
2 240 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/03/25	2 163 392	0,81	580 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/38	471 714	0,18
1 380 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/25	1 339 014	0,50	1 341 663 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/10/38	1 533 252	0,58
2 004 924 EUR	French Republic Government Bond OAT, 6.000%, 25/10/25	2 126 623	0,80	795 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.750%, 25/06/39	690 776	0,26
1 055 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/11/25	1 026 621	0,39	380 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/40	262 998	0,10
1 340 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/26	1 274 072	0,48	1 794 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.500%, 25/04/41	2 186 707	0,82
1 715 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/04/26	1 757 361	0,67	570 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 25/05/43	530 100	0,20
2 110 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/26	2 019 692	0,76	330 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/06/44	206 646	0,08

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,80 % (suite)				Obligations d'État – 98,80 % (suite)			
France (suite)				Allemagne (suite)			
1 260 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.250%, 25/05/45	1 314 306	0,49	420 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/27	389 357	0,15
1 555 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.000%, 25/05/48	1 285 829	0,48	1 219 388 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.625%, 04/01/28	1 386 359	0,52
1 820 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.500%, 25/05/50	1 321 684	0,50	680 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/28	641 940	0,24
800 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/52	458 240	0,17	945 827 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/28	1 055 638	0,40
1 740 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/53	976 314	0,37	905 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/08/28	839 650	0,32
610 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.000%, 25/05/54	598 593	0,23	600 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/28	547 284	0,21
1 118 340 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/04/55	1 319 529	0,50	1 320 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/29	1 215 694	0,46
1 054 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/04/60	1 260 268	0,47	1 440 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/29	1 296 792	0,49
75 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.750%, 25/05/66	53 438	0,02	1 370 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.100%, 15/11/29	1 382 837	0,52
90 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/72	37 359	0,01	784 558 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.250%, 04/01/30	972 499	0,37
980 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.750%, perpetual	1 003 128	0,38	1 165 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/30	1 037 607	0,39
1 220 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.000%, perpetual	1 268 312	0,48	1 390 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/30	1 227 801	0,46
France – Total		66 795 646	25,17	150 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.400%, 15/11/30	154 335	0,06
Allemagne				1 478 806 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.500%, 04/01/31	1 816 565	0,69
945 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 11/04/25	912 917	0,34	640 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/31	559 366	0,21
1 430 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/10/25	1 370 855	0,52	770 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/31	665 965	0,25
1 290 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/04/26	1 227 048	0,46	945 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/32	807 777	0,30
1 290 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 09/10/26	1 216 599	0,46	760 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.700%, 15/08/32	743 500	0,28
1 210 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 16/04/27	1 132 766	0,43	1 510 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.300%, 15/02/33	1 547 161	0,58
1 010 000 EUR	Bundesobligation, 1.300%, 15/10/27	985 699	0,37	680 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.600%, 15/08/33	713 313	0,27
1 270 000 EUR	Bundesobligation, 2.200%, 13/04/28	1 281 519	0,48	655 320 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/34	819 104	0,31
1 240 000 EUR	Bundesobligation, 2.400%, 19/10/28	1 265 160	0,48	1 160 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/05/35	912 978	0,34
1 305 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/25	1 270 992	0,48	1 470 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/05/36	1 126 270	0,42
1 385 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.000%, 15/08/25	1 351 525	0,51	1 405 395 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.000%, 04/01/37	1 689 875	0,64
1 080 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/26	1 040 256	0,39	790 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.000%, 15/05/38	671 184	0,25
855 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/26	809 069	0,31	1 039 074 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.250%, 04/07/39	1 307 332	0,49
780 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/27	738 091	0,28	1 107 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/40	1 480 812	0,56
926 580 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.500%, 04/07/27	1 062 481	0,40	986 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 3.250%, 04/07/42	1 126 042	0,42
855 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/08/27	811 301	0,31	1 032 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.500%, 04/07/44	1 066 170	0,40

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets			
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)						
Obligations d'État – 98,80 % (suite)				Obligations d'État – 98,80 % (suite)						
Allemagne (suite)				Italie (suite)						
860 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.500%, 15/08/46	893 084	0,34	630 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.400%, 28/03/25	631 790	0,24			
940 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.250%, 15/08/48	763 571	0,29	245 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.450%, 15/05/25	239 689	0,09			
1 730 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/50	963 748	0,36	690 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.500%, 01/06/25	675 013	0,25			
140 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/50	78 338	0,03	290 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.850%, 01/07/25	284 772	0,11			
1 680 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/52	895 322	0,34	200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.200%, 15/08/25	194 428	0,07			
1 050 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.800%, 15/08/53	946 775	0,36	80 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.600%, 29/09/25	80 830	0,03			
1 050 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.500%, 13/03/25	1 045 831	0,39	370 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 15/11/25	367 311	0,14			
510 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 3.100%, 18/09/25	514 922	0,19	720 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.000%, 01/12/25	708 261	0,27			
380 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.800%, perpetual	380 688	0,14	600 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.500%, 15/01/26	607 549	0,23			
Allemagne – Total		52 159 764	19,66	1 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.500%, 01/02/26	1 095 215	0,41			
Irlande				1 258 000 EUR				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.500%, 01/03/26	1 300 701	0,49
116 000 EUR	Ireland Government Bond, 5.400%, 13/03/25	119 086	0,04	800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/04/26	750 875	0,28			
505 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.000%, 15/05/26	489 648	0,18	720 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.800%, 15/04/26	735 407	0,28			
470 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.200%, 15/05/27	439 497	0,17	955 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.600%, 01/06/26	928 368	0,35			
645 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.900%, 15/05/28	609 783	0,23	910 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.100%, 15/07/26	894 445	0,34			
450 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.100%, 15/05/29	424 395	0,16	470 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/08/26	437 531	0,16			
575 000 EUR	Ireland Government Bond, 2.400%, 15/05/30	579 542	0,22	190 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 15/09/26	195 043	0,07			
230 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.200%, 18/10/30	199 870	0,08	769 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 7.250%, 01/11/26	860 942	0,32			
80 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.350%, 18/10/32	67 168	0,03	390 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.250%, 01/12/26	373 384	0,14			
220 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.300%, 15/05/33	199 254	0,07	630 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.850%, 15/01/27	594 538	0,22			
330 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.400%, 15/05/35	260 964	0,10	670 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.100%, 01/04/27	634 838	0,24			
460 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.700%, 15/05/37	409 400	0,15	650 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.200%, 01/06/27	637 037	0,24			
610 000 EUR	Ireland Government Bond, 2.000%, 18/02/45	524 844	0,20	1 040 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.050%, 01/08/27	1 012 365	0,38			
390 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.500%, 15/05/50	292 188	0,11	1 020 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 15/09/27	952 548	0,36			
Irlande – Total		4 615 639	1,74	2 039 705 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.500%, 01/11/27	2 304 967	0,87			
Italie				720 000 EUR				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.650%, 01/12/27	714 066	0,27
940 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 01/12/24	932 580	0,35	975 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.000%, 01/02/28	942 112	0,36			
360 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 15/12/24	349 178	0,13	310 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.250%, 15/03/28	277 630	0,10			
905 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.350%, 01/02/25	877 075	0,33	450 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.400%, 01/04/28	458 209	0,17			
1 339 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/03/25	1 365 199	0,51							

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,80 % (suite)				Obligations d'État – 98,80 % (suite)			
Italie (suite)				Italie (suite)			
210 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.500%, 15/07/28	188 385	0,07	770 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 30/04/35	785 458	0,30
300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.800%, 01/08/28	310 219	0,12	60 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.450%, 01/03/36	46 111	0,02
1 050 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.750%, 01/09/28	1 129 985	0,43	195 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.250%, 01/09/36	163 233	0,06
470 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 01/12/28	466 107	0,18	1 539 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 01/02/37	1 556 070	0,59
180 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.450%, 15/02/29	158 068	0,06	90 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/03/37	62 964	0,02
770 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 15/06/29	758 460	0,29	200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.250%, 01/03/38	183 491	0,07
1 230 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.000%, 01/08/29	1 224 368	0,46	200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.950%, 01/09/38	177 011	0,07
1 821 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.250%, 01/11/29	2 026 313	0,76	1 314 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/08/39	1 449 375	0,55
860 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 15/12/29	890 699	0,34	900 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.100%, 01/03/40	796 033	0,30
1 370 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.500%, 01/03/30	1 394 700	0,53	693 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/09/40	764 894	0,29
710 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.350%, 01/04/30	635 998	0,24	105 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.800%, 01/03/41	75 626	0,03
285 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/08/30	246 213	0,09	515 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.450%, 01/09/43	530 758	0,20
520 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 15/11/30	542 362	0,20	830 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.750%, 01/09/44	891 410	0,34
1 320 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.650%, 01/12/30	1 185 403	0,45	1 120 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.250%, 01/09/46	968 855	0,37
480 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.900%, 01/04/31	405 567	0,15	410 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.700%, 01/03/47	322 549	0,12
1 750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.000%, 01/05/31	2 056 285	0,77	1 130 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.450%, 01/03/48	1 007 708	0,38
340 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.600%, 01/08/31	277 581	0,10	945 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 01/09/49	891 145	0,34
640 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 30/10/31	666 493	0,25	875 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.450%, 01/09/50	638 888	0,24
320 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/12/31	265 944	0,10	560 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.150%, 01/09/52	372 220	0,14
540 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.650%, 01/03/32	471 751	0,18	630 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.500%, 01/10/53	647 371	0,24
330 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/06/32	269 981	0,10	70 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 01/03/67	50 999	0,02
1 040 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 01/12/32	959 540	0,36	760 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.700%, perpetual	779 341	0,29
1 157 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.750%, 01/02/33	1 349 708	0,51	Italie – Total		59 848 394	22,56
750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.400%, 01/05/33	798 741	0,30	Pays-Bas			
1 080 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.450%, 01/09/33	979 245	0,37	380 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/25	366 776	0,14
570 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.350%, 01/11/33	603 280	0,23	170 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/26	161 601	0,06
700 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.200%, 01/03/34	731 926	0,28	1 010 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/26	965 762	0,36
1 308 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/08/34	1 453 590	0,55	915 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/27	855 616	0,32
860 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.350%, 01/03/35	826 076	0,31	635 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/27	604 266	0,23

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,80 % (suite)				Obligations d'État – 98,80 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Espagne (suite)			
963 436 EUR	Netherlands Government Bond, 5.500%, 15/01/28	1 083 576	0,41	1 390 000 EUR	Spain Government Bond, 1.300%, 31/10/26	1 342 280	0,51
340 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/28	319 362	0,12	1 280 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/27	1 183 782	0,45
440 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/29	394 900	0,15	930 000 EUR	Spain Government Bond, 1.500%, 30/04/27	899 065	0,34
40 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/29	36 048	0,01	1 285 000 EUR	Spain Government Bond, 0.800%, 30/07/27	1 208 889	0,46
780 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/30	676 806	0,26	1 190 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 31/10/27	1 143 279	0,43
110 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/31	93 170	0,04	650 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/28	586 729	0,22
790 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/32	679 163	0,26	760 000 EUR	Spain Government Bond, 1.400%, 30/04/28	724 700	0,27
972 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/01/33	985 122	0,37	540 000 EUR	Spain Government Bond, 1.400%, 30/07/28	513 252	0,19
220 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/07/33	222 464	0,08	1 060 000 EUR	Spain Government Bond, 5.150%, 31/10/28	1 183 178	0,45
988 092 EUR	Netherlands Government Bond, 4.000%, 15/01/37	1 150 831	0,43	1 691 338 EUR	Spain Government Bond, 6.000%, 31/01/29	1 963 256	0,74
15 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/38	10 580	0,00	730 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 30/04/29	689 056	0,26
175 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/01/40	129 307	0,05	1 360 000 EUR	Spain Government Bond, 0.800%, 30/07/29	1 232 418	0,46
761 000 EUR	Netherlands Government Bond, 3.750%, 15/01/42	895 393	0,34	490 000 EUR	Spain Government Bond, 0.600%, 31/10/29	436 806	0,16
255 000 EUR	Netherlands Government Bond, 3.250%, 15/01/44	283 220	0,11	1 025 000 EUR	Spain Government Bond, 0.500%, 30/04/30	896 854	0,34
985 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.750%, 15/01/47	1 029 916	0,39	475 000 EUR	Spain Government Bond, 1.950%, 30/07/30	453 942	0,17
490 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/52	251 272	0,09	1 330 000 EUR	Spain Government Bond, 1.250%, 31/10/30	1 209 249	0,46
400 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.000%, 15/01/54	360 080	0,14	470 000 EUR	Spain Government Bond, 0.100%, 30/04/31	388 145	0,15
420 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, perpetual	427 182	0,16	410 000 EUR	Spain Government Bond, 0.500%, 31/10/31	344 539	0,13
Pays-Bas – Total		11 982 413	4,52	480 000 EUR	Spain Government Bond, 0.700%, 30/04/32	404 674	0,15
Espagne				1 229 000 EUR	Spain Government Bond, 5.750%, 30/07/32	1 497 069	0,56
770 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/25	744 706	0,28	990 000 EUR	Spain Government Bond, 2.550%, 31/10/32	964 438	0,36
700 000 EUR	Spain Government Bond, 1.600%, 30/04/25	687 209	0,26	1 160 000 EUR	Spain Government Bond, 3.150%, 30/04/33	1 178 398	0,44
790 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/05/25	758 052	0,29	1 135 000 EUR	Spain Government Bond, 2.350%, 30/07/33	1 078 171	0,41
586 000 EUR	Spain Government Bond, 4.650%, 30/07/25	601 487	0,23	1 130 000 EUR	Spain Government Bond, 3.550%, 31/10/33	1 182 477	0,45
640 000 EUR	Spain Government Bond, 2.150%, 31/10/25	633 305	0,24	690 000 EUR	Spain Government Bond, 1.850%, 30/07/35	603 791	0,23
420 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/26	397 316	0,15	1 047 000 EUR	Spain Government Bond, 4.200%, 31/01/37	1 155 051	0,44
990 000 EUR	Spain Government Bond, 1.950%, 30/04/26	974 355	0,37	260 000 EUR	Spain Government Bond, 3.900%, 30/07/39	275 298	0,10
690 000 EUR	Spain Government Bond, 2.800%, 31/05/26	692 574	0,26	1 135 000 EUR	Spain Government Bond, 4.900%, 30/07/40	1 340 000	0,50
1 270 000 EUR	Spain Government Bond, 5.900%, 30/07/26	1 371 381	0,52	175 000 EUR	Spain Government Bond, 1.200%, 31/10/40	124 724	0,05

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,80 % (suite)			
Espagne (suite)			
875 000 EUR	Spain Government Bond, 4.700%, 30/07/41	1 020 011	0,38
100 000 EUR	Spain Government Bond, 1.000%, 30/07/42	66 707	0,02
240 000 EUR	Spain Government Bond, 3.450%, 30/07/43	237 605	0,09
955 000 EUR	Spain Government Bond, 5.150%, 31/10/44	1 184 257	0,45
1 175 000 EUR	Spain Government Bond, 2.900%, 31/10/46	1 058 859	0,40
1 055 000 EUR	Spain Government Bond, 2.700%, 31/10/48	904 890	0,34
155 000 EUR	Spain Government Bond, 1.000%, 31/10/50	86 857	0,03
540 000 EUR	Spain Government Bond, 1.900%, 31/10/52	373 070	0,14
1 015 000 EUR	Spain Government Bond, 3.450%, 30/07/66	936 747	0,35
70 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 31/10/71	34 252	0,01
Espagne – Total		38 967 150	14,69
Total des obligations d'État		262 136 620	98,80
Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
		262 136 620	98,80
TOTAL DES INVESTISSEMENTS		262 136 620	98,80
Autres actifs/(passifs) nets		3 178 399	1,20
TOTAL DES ACTIFS NETS		265 315 019	100,00

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Obligations d'État – 99,60 %				Obligations d'État – 99,60 % (<i>suite</i>)			
France				Italie (<i>suite</i>)			
1 767 614	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.100%, 01/03/25	1 742 514	2,53	2 294 351	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.550%, 15/09/41	2 458 466	3,57
7 242 447	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.100%, 01/03/26	6 954 918	10,11	980 339	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.150%, 15/05/51	622 045	0,91
3 877 631	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.850%, 25/07/27	4 101 254	5,96	Italie – Total			
2 241 671	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.100%, 01/03/28	2 212 866	3,21	18 951 467 27,54			
2 248 353	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.100%, 01/03/29	2 231 962	3,24	Espagne			
1 717 661	EUR French Republic Government Bond OAT, 3.400%, 25/07/29	2 007 086	2,92	2 372 608	EUR Spain Government Inflation Linked Bond, 0.650%, 30/11/27	2 367 388	3,44
2 597 306	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.700%, 25/07/30	2 678 108	3,89	2 629 624	EUR Spain Government Inflation Linked Bond, 1.000%, 30/11/30	2 656 841	3,86
2 068 456	EUR French Republic Government Bond OAT, 3.150%, 25/07/32	2 552 641	3,71	2 728 402	EUR Spain Government Inflation Linked Bond, 0.700%, 30/11/33	2 639 920	3,84
386 935	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.600%, 25/07/34	391 559	0,57	391 436	EUR Spain Government Inflation Linked Bond, 2.050%, 30/11/39	427 965	0,62
1 925 878	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.100%, 25/07/36	1 821 206	2,65	Espagne – Total			
471 507	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.550%, 01/03/39	465 665	0,68	8 092 114 11,76			
2 180 045	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.800%, 25/07/40	2 590 634	3,76	Total des obligations d'État			
1 939 396	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.100%, 25/07/47	1 711 285	2,49	68 543 307 99,60			
France – Total				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
31 461 698 45,72				68 543 307 99,60			
Allemagne				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
2 873 765	EUR Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, 0.100%, 15/04/26	2 826 520	4,11	68 543 307 99,60			
3 427 353	EUR Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, 0.500%, 15/04/30	3 520 886	5,11	Autres actifs/(passifs) nets			
1 515 312	EUR Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, 0.100%, 15/04/33	1 524 465	2,21	276 640 0,40			
2 171 826	EUR Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, 0.100%, 15/04/46	2 166 157	3,15	TOTAL DES ACTIFS NETS			
Allemagne – Total				68 819 947 100,00			
10 038 028 14,58							
Italie							
1 264 826	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.650%, 15/05/26	1 245 815	1,81				
2 105 428	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.100%, 15/09/26	2 220 364	3,23				
2 362 617	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.300%, 15/05/28	2 361 766	3,43				
879 000	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.500%, 15/05/29	881 478	1,28				
1 978 977	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.400%, 15/05/30	1 849 967	2,69				
2 241 891	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.250%, 15/09/32	2 176 630	3,16				
2 436 501	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.100%, 15/05/33	2 086 230	3,03				
2 309 627	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.350%, 15/09/35	2 454 718	3,57				
572 673	EUR Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.400%, 15/05/39	593 988	0,86				

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)				
Obligations d'entreprise – 98,62 %				Obligations d'entreprise – 98,62 % (<i>suite</i>)				
Australie				Australie (<i>suite</i>)				
350 000 EUR	APA Infrastructure Ltd, 2.000%, 22/03/27	334 334	0,04	290 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 3.000%, 08/04/30	283 736	0,03	
200 000 EUR	APA Infrastructure Ltd, 0.750%, 15/03/29	174 036	0,02	200 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 4.225%, 26/04/33	210 496	0,02	
200 000 EUR	APA Infrastructure Ltd, 2.000%, 15/07/30	180 172	0,02	300 000 EUR	Wesfarmers Ltd, 0.954%, 21/10/33	241 350	0,03	
690 000 EUR	Ausgrid Finance Pty Ltd, 1.250%, 30/07/25	665 574	0,08	400 000 EUR	Westpac Banking Corp, 3.703%, 16/01/26	403 508	0,05	
600 000 EUR	Ausnet Services Holdings Pty Ltd, 1.500%, 26/02/27	564 480	0,07	180 000 EUR	Westpac Banking Corp, 0.875%, 17/04/27	167 031	0,02	
300 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 3.652%, 20/01/26	302 232	0,04	315 000 EUR	Westpac Banking Corp, 1.450%, 17/07/28	293 715	0,03	
400 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 5.101%, 03/02/33	411 092	0,05	325 000 EUR	Westpac Banking Corp, 0.766%, 13/05/31	297 908	0,04	
200 000 EUR	Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd, 4.375%, perpetual	211 546	0,03	500 000 EUR	Westpac Banking Corp, 3.799%, perpetual	515 300	0,06	
202 000 EUR	BHP Billiton Finance Ltd, 3.250%, 24/09/27	203 909	0,02	Australie – Total			10 105 766	1,18
250 000 EUR	BHP Billiton Finance Ltd, 1.500%, 29/04/30	223 948	0,03	Autriche				
270 000 EUR	BHP Billiton Finance Ltd, 3.125%, 29/04/33	263 201	0,03	200 000 EUR	A1 Towers Holding GmbH, 5.250%, 13/07/28	211 670	0,03	
180 000 EUR	Goodman Australia Finance Pty Ltd, 1.375%, 27/09/25	173 977	0,02	300 000 EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 4.125%, 18/01/27	304 233	0,04	
195 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.625%, 03/02/27	178 977	0,02	500 000 EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 0.375%, 03/09/27	449 810	0,05	
300 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.943%, 19/01/29	263 556	0,03	200 000 EUR	CA Immobilien Anlagen AG, 1.000%, 27/10/25	182 986	0,02	
100 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 4.747%, 23/01/30	105 158	0,01	500 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.050%, 16/09/25	472 600	0,06	
400 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.950%, 21/05/31	331 768	0,04	200 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.875%, 22/05/26	189 456	0,02	
300 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 2.125%, 24/05/28	289 689	0,03	700 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.875%, 13/05/27	632 982	0,07	
370 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 1.375%, 30/08/28	342 087	0,04	200 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.125%, 17/05/28	175 464	0,02	
190 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 1.125%, 20/05/31	170 229	0,02	200 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.250%, 14/09/29	168 608	0,02	
280 000 EUR	Stockland Trust, 1.625%, 27/04/26	265 896	0,03	200 000 EUR	Erste Group Bank AG, 4.250%, 30/05/30	207 572	0,02	
400 000 EUR	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd, 4.375%, perpetual	420 748	0,05	300 000 EUR	Erste Group Bank AG, 1.000%, 10/06/30	283 017	0,03	
220 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.125%, 14/04/26	210 910	0,02	100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 1.000%, 10/06/30	94 339	0,01	
195 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.375%, 26/03/29	180 162	0,02	300 000 EUR	Erste Group Bank AG, 4.000%, 16/01/31	310 467	0,04	
270 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.000%, 23/04/30	240 519	0,03	200 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.250%, 27/01/31	163 032	0,02	
190 000 EUR	Toyota Finance Australia Ltd, 2.280%, 21/10/27	185 273	0,02	200 000 EUR	Erste Group Bank AG, 1.625%, 08/09/31	186 612	0,02	
130 000 EUR	Toyota Finance Australia Ltd, 0.440%, 13/01/28	117 443	0,01	300 000 EUR	Erste Group Bank AG, 4.000%, 07/06/33	294 996	0,04	
350 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 2.000%, 28/08/25	341 961	0,04	290 000 EUR	Mondi Finance Europe GmbH, 2.375%, 01/04/28	284 154	0,03	
90 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 1.750%, 29/03/28	84 787	0,01	350 000 EUR	OMV AG, 0.010%, 03/07/25	333 294	0,04	
280 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 1.450%, 16/05/29	255 058	0,03					

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Autriche (suite)				Belgique (suite)			
550 000	EUR OMV AG, 1.000%, 14/12/26	522 973	0,06	200 000	EUR Argenta Spaarbank NV, 5.375%, 29/11/27	206 828	0,03
350 000	EUR OMV AG, 1.875%, 04/12/28	333 228	0,04	200 000	EUR Argenta Spaarbank NV, 1.375%, 08/02/29	177 680	0,02
320 000	EUR OMV AG, 6.250%, perpetual	331 091	0,04	300 000	EUR Cofinimmo SA, 1.000%, 24/01/28	271 644	0,03
400 000	EUR OMV AG, 2.500%, perpetual	376 668	0,04	200 000	EUR Crelan SA, 6.000%, 28/02/30	211 630	0,03
1 000 000	EUR Raiffeisen Bank International AG, 4.125%, 08/09/25	1 005 590	0,12	100 000	EUR Elia Group SA/NV, 1.500%, 05/09/28	92 982	0,01
500 000	EUR Raiffeisen Bank International AG, 4.750%, 26/01/27	505 545	0,06	200 000	EUR Elia Transmission Belgium SA, 1.375%, 14/01/26	192 286	0,02
200 000	EUR Raiffeisen Bank International AG, 6.000%, 15/09/28	208 652	0,02	100 000	EUR Elia Transmission Belgium SA, 3.000%, 07/04/29	99 061	0,01
400 000	EUR Raiffeisen Bank International AG, 1.500%, 12/03/30	372 820	0,04	300 000	EUR Elia Transmission Belgium SA, 0.875%, 28/04/30	261 519	0,03
400 000	EUR Raiffeisen Bank International AG, 2.875%, 18/06/32	358 436	0,04	300 000	EUR Elia Transmission Belgium SA, 3.625%, 18/01/33	309 621	0,04
300 000	EUR Raiffeisen Bank International AG, 7.375%, 20/12/32	315 726	0,04	190 000	EUR Euroclear Bank SA, 0.125%, 07/07/25	181 355	0,02
200 000	EUR Raiffeisen Bank International AG, 1.375%, 17/06/33	163 526	0,02	250 000	EUR Euroclear Bank SA, 3.625%, 13/10/27	255 590	0,03
100 000	EUR UNIQA Insurance Group AG, 6.000%, 27/07/46	102 558	0,01	200 000	EUR Euroclear Investments SA, 1.125%, 07/12/26	190 562	0,02
300 000	EUR Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe, 4.875%, 15/06/42	300 948	0,04	200 000	EUR Groupe Bruxelles Lambert NV, 3.125%, 06/09/29	200 586	0,02
200 000	EUR Volksbank Wien AG, 0.875%, 23/03/26	185 928	0,02	200 000	EUR Groupe Bruxelles Lambert NV, 0.125%, 28/01/31	161 016	0,02
300 000	EUR Volksbank Wien AG, 4.750%, 15/03/27	308 058	0,04	400 000	EUR Groupe Bruxelles Lambert NV, 4.000%, perpetual	420 460	0,05
200 000	EUR Wienerberger AG, 4.875%, 04/10/28	212 002	0,03	500 000	EUR KBC Group NV, 4.500%, 06/06/26	505 415	0,06
Autriche – Total		10 549 041	1,24	200 000	EUR KBC Group NV, 0.125%, 10/09/26	188 594	0,02
Belgique				500 000	EUR KBC Group NV, 0.250%, 01/03/27	467 630	0,06
300 000	EUR AG Insurance SA, 3.500%, 30/06/47	287 940	0,03	300 000	EUR KBC Group NV, 4.375%, 23/11/27	307 047	0,04
200 000	EUR Ageas SA/NV, 3.250%, 02/07/49	186 692	0,02	500 000	EUR KBC Group NV, 0.750%, 21/01/28	460 080	0,05
760 000	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.150%, 22/01/27	721 886	0,09	200 000	EUR KBC Group NV, 0.125%, 14/01/29	175 010	0,02
300 000	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.125%, 02/12/27	292 167	0,03	200 000	EUR KBC Group NV, 4.250%, 28/11/29	205 492	0,02
1 000 000	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.000%, 17/03/28	971 550	0,11	400 000	EUR KBC Group NV, 0.750%, 24/01/30	343 504	0,04
400 000	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.500%, 18/04/30	367 864	0,04	400 000	EUR KBC Group NV, 3.000%, 25/08/30	389 784	0,05
400 000	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.650%, 28/03/31	366 924	0,04	700 000	EUR KBC Group NV, 0.750%, 31/05/31	586 936	0,07
580 000	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.875%, 02/04/32	573 817	0,07	200 000	EUR KBC Group NV, 4.375%, 06/12/31	210 674	0,03
250 000	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3.250%, 24/01/33	255 352	0,03	200 000	EUR KBC Group NV, 0.625%, 07/12/31	180 500	0,02
1 380 000	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.750%, 17/03/36	1 315 223	0,15	500 000	EUR KBC Group NV, 4.875%, 25/04/33	511 090	0,06
970 000	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3.700%, 02/04/40	991 146	0,12	300 000	EUR KBC Group NV, 4.375%, perpetual	311 403	0,04
200 000	EUR Argenta Spaarbank NV, 1.000%, 13/10/26	188 766	0,02	690 000	EUR Lonza Finance International NV, 1.625%, 21/04/27	661 296	0,08
200 000	EUR Argenta Spaarbank NV, 1.000%, 29/01/27	182 510	0,02	200 000	EUR Lonza Finance International NV, 3.875%, 25/05/33	207 504	0,03
				200 000	EUR Solvay SA, 2.750%, 02/12/27	196 224	0,02
				200 000	EUR Solvay SA, 2.500%, 31/12/99	189 778	0,02
				200 000	EURVGP NV, 2.250%, 17/01/30	157 336	0,02
				Belgique – Total		16 189 954	1,90
				Bermudes			
				300 000	EUR FIL Ltd, 2.500%, 04/11/26 16/06/28	310 017	0,04
				200 000	EUR FIL Ltd, 2.500%, 04/11/26	192 786	0,02
				Bermudes – Total		502 803	0,06

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Îles Vierges britanniques				République tchèque			
150 000 EUR	Global Switch Holdings Ltd, 2.250%, 31/05/27	145 973	0,02	300 000 EUR	Ceska sporitelna AS, 5.943%, 29/06/27	311 181	0,04
Îles Vierges britanniques – Total				République tchèque – Total			
145 973				1 250 583			
Canada				Danemark			
220 000 EUR	Alimentation Couche-Tard Inc, 1.875%, 06/05/26	212 315	0,02	200 000 EUR	Aareal Bank AG, 0.750%, 18/04/28	172 550	0,02
300 000 EUR	Bank of Montreal, 2.750%, 15/06/27	295 089	0,03	240 000 EUR	AP Moller - Maersk A/S, 1.750%, 16/03/26	232 270	0,03
290 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 0.125%, 04/09/26	267 743	0,03	335 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 0.375%, 30/06/27	305 409	0,04
300 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 0.250%, 01/11/28	260 409	0,03	200 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 4.000%, 05/10/28	207 344	0,02
350 000 EUR	Fairfax Financial Holdings Ltd, 2.750%, 29/03/28	333 722	0,04	200 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 0.875%, 01/07/29	177 762	0,02
710 000 EUR	Great-West Lifeco Inc, 1.750%, 07/12/26	689 296	0,08	170 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 0.625%, 09/03/30	146 061	0,02
200 000 EUR	Great-West Lifeco Inc, 4.700%, 16/11/29	214 360	0,03	200 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 4.250%, 05/10/33	212 580	0,03
250 000 EUR	Magna International Inc, 1.500%, 25/09/27	238 458	0,03	500 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 3.500%, perpetual	506 205	0,06
250 000 EUR	Magna International Inc, 4.375%, 17/03/32	266 495	0,03	300 000 EUR	Danske Bank A/S, 4.000%, 12/01/27	302 370	0,04
333 000 EUR	Royal Bank of Canada, 4.125%, 05/07/28	343 599	0,04	300 000 EUR	Danske Bank A/S, 1.375%, 17/02/27	285 882	0,03
400 000 EUR	Royal Bank of Canada, 2.125%, 26/04/29	376 928	0,04	200 000 EUR	Danske Bank A/S, 4.500%, 09/11/28	206 380	0,02
270 000 EUR	Royal Bank of Canada, 4.375%, 02/10/30	283 821	0,03	300 000 EUR	Danske Bank A/S, 4.750%, 21/06/30	316 329	0,04
300 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 0.500%, 18/01/27	277 749	0,03	1 000 000 EUR	Danske Bank A/S, 4.125%, 10/01/31	1 036 040	0,12
500 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 2.551%, 03/08/27	489 195	0,06	300 000 EUR	Danske Bank A/S, 1.000%, 15/05/31	279 924	0,03
1 000 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 3.631%, 13/12/29	1 011 740	0,12	200 000 EUR	EON SE, 2.875%, perpetual	199 272	0,02
500 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 3.129%, 03/08/32	489 030	0,06	370 000 EUR	ISS Global A/S, 0.875%, 18/06/26	346 897	0,04
500 000 EUR	TotalEnergies Capital Canada Ltd, 2.125%, 18/09/29	478 285	0,06	250 000 EUR	ISS Global A/S, 1.500%, 31/08/27	233 395	0,03
Canada – Total				200 000 EUR Jyske Bank A/S, 4.625%, 11/04/26			
6 528 234				201 800			
Îles Caïmans				200 000 EUR Jyske Bank A/S, 0.050%, 02/09/26			
450 000 EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1.250%, 13/04/25	434 911	0,05	355 000 EUR	Jyske Bank A/S, 0.050%, 02/09/26	333 391	0,04
250 000 EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 2.000%, 13/04/30	226 650	0,03	200 000 EUR	Jyske Bank A/S, 5.500%, 16/11/27	209 794	0,02
300 000 EUR	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd, 0.750%, 02/11/29	254 541	0,03	200 000 EUR	Jyske Bank A/S, 0.250%, 17/02/28	181 532	0,02
380 000 EUR	CK Hutchison Finance 16 Ltd, 2.000%, 06/04/28	360 856	0,04	125 000 EUR	Jyske Bank A/S, 5.000%, 26/10/28	129 970	0,02
Îles Caïmans – Total				50 000 EUR Nykredit Realkredit AS, 0.625%, 17/01/25			
1 276 958				48 475			
				790 000 EUR Nykredit Realkredit AS, 0.500%, 10/07/25			
				200 000 EUR Nykredit Realkredit AS, 0.250%, 13/01/26			
				300 000 EUR Nykredit Realkredit AS, 0.750%, 20/01/27			
				400 000 EUR Nykredit Realkredit AS, 1.375%, 12/07/27			

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Danemark (suite)				Finlande (suite)			
500 000 EUR	Nykredit Realkredit AS 0.375%, 17/01/28	440 335	0,05	135 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.250%, 24/03/26	126 079	0,02
180 000 EUR	Sydbank AS, 5.125%, 06/09/28	185 938	0,02	200 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.600%, 18/01/27	183 498	0,02
200 000 EUR	TDC Net A/S, 5.618%, 06/02/30	206 066	0,02	348 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 4.125%, 18/04/27	357 977	0,04
200 000 EUR	TDC Net A/S, 6.500%, perpetual	211 882	0,03	325 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.625%, 27/07/27	295 159	0,04
900 000 EUR	Vestas Wind Systems A/S, 4.125%, 15/06/31	928 800	0,11	285 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.100%, 16/11/27	253 795	0,03
Danemark – Total		9 838 106	1,15	600 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 4.000%, 13/06/28	619 938	0,07
Estonie				75 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.375%, 16/06/28	66 115	0,01
100 000 EUR	Luminor Bank AS/Estonia, 0.539%, 23/09/26	91 815	0,01	205 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.375%, 08/12/28	177 223	0,02
500 000 EUR	Luminor Bank AS/Estonia, 7.750%, 08/06/27	526 985	0,06	100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.625%, 12/11/29	85 706	0,01
Estonie – Total		618 800	0,07	200 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.750%, 24/03/31	169 956	0,02
Finlande				550 000 EUR	Sampo Oyj, 3.375%, 23/05/49	517 671	0,06
485 000 EUR	Balder Finland Oyj, 1.375%, 24/05/30	351 911	0,04	280 000 EUR	Sato Oyj, 1.375%, 24/02/28	233 587	0,03
260 000 EUR	Elenia Verkko Oyj, 0.375%, 06/02/27	236 662	0,03	500 000 EUR	Stora Enso Oyj, 2.500%, 07/06/27	488 805	0,06
385 000 EUR	Elisa Oyj, 0.250%, 15/09/27	348 822	0,04	100 000 EUR	Stora Enso Oyj, 0.625%, 02/12/30	81 407	0,01
200 000 EUR	Elisa Oyj, 4.000%, 27/01/29	207 090	0,02	200 000 EUR	Stora Enso Oyj, 4.000%, perpetual	202 294	0,02
380 000 EUR	Kojamo Oyj, 1.625%, 07/03/25	363 816	0,04	200 000 EUR	Stora Enso Oyj, 4.250%, perpetual	205 072	0,02
460 000 EUR	Kojamo Oyj, 1.875%, 27/05/27	411 212	0,05	1 100 000 EUR	Teollisuuden Voima Oyj, 4.750%, 01/06/30	1 152 217	0,14
200 000 EUR	Neste Oyj, 0.750%, 25/03/28	181 458	0,02	200 000 EUR	UPM-Kymmene Oyj, 2.250%, 23/05/29	191 102	0,02
200 000 EUR	Neste Oyj, 3.875%, 16/03/29	206 142	0,02	400 000 EUR	UPM-Kymmene Oyj, 0.500%, 22/03/31	329 688	0,04
200 000 EUR	Neste Oyj, 3.875%, 21/05/31	207 478	0,02	Finlande – Total		13 589 094	1,59
100 000 EUR	Neste Oyj, 4.250%, 16/03/33	106 907	0,01	France			
200 000 EUR	Nokia Oyj, 2.000%, 11/03/26	192 666	0,02	200 000 EUR	Abeille Vie Sa d'Assurances Vie et de Capitalisation SA, 6.250%, 09/09/33	217 724	0,03
200 000 EUR	Nokia Oyj, 3.125%, 15/05/28	195 520	0,02	200 000 EUR	Accor SA, 3.000%, 04/02/26	192 304	0,02
400 000 EUR	Nokia Oyj, 4.375%, 21/08/31	402 132	0,05	300 000 EUR	Accor SA, 2.375%, 29/11/28	285 963	0,03
300 000 EUR	Nordea Bank Abp, 3.625%, 10/02/26	299 223	0,04	200 000 EUR	Air Liquide Finance SA, 1.250%, 03/06/25	195 036	0,02
620 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.375%, 28/05/26	582 478	0,07	500 000 EUR	Air Liquide Finance SA, 1.000%, 08/03/27	476 105	0,06
300 000 EUR	Nordea Bank Abp, 1.125%, 16/02/27	281 811	0,03	200 000 EUR	Air Liquide Finance SA, 1.375%, 02/04/30	184 156	0,02
540 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 14/05/27	498 528	0,06	500 000 EUR	Air Liquide Finance SA, 0.625%, 20/06/30	438 025	0,05
400 000 EUR	Nordea Bank Abp, 1.125%, 27/09/27	377 620	0,04	300 000 EUR	ALD SA, 4.750%, 13/10/25	305 841	0,04
400 000 EUR	Nordea Bank Abp, 4.125%, 05/05/28	412 940	0,05	500 000 EUR	ALD SA, 4.000%, 05/07/27	510 945	0,06
300 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 02/11/28	263 514	0,03	300 000 EUR	ALD SA, 4.875%, 06/10/28	317 595	0,04
750 000 EUR	Nordea Bank Abp, 2.500%, 23/05/29	721 297	0,09	200 000 EUR	Alstom SA, 0.250%, 14/10/26	181 172	0,02
200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 2.875%, 24/08/32	193 764	0,02	300 000 EUR	Alstom SA, 0.125%, 27/07/27	263 226	0,03
200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 4.875%, 23/02/34	207 840	0,03	400 000 EUR	Alstom SA, 0.500%, 27/07/30	324 116	0,04
210 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 1.000%, 22/05/25	202 978	0,02	100 000 EUR	Altarea SCA, 1.750%, 16/01/30	76 947	0,01
400 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 2.875%, 15/12/25	397 996	0,05	300 000 EUR	Aprr SA, 1.500%, 25/01/30	276 351	0,03
				300 000 EUR	APRR SA, 1.250%, 06/01/27	286 158	0,03

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
300 000	EUR APRR SA, 1.250%, 14/01/27	285 768	0,03	500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.875%, 14/02/28	512 890	0,06
300 000	EUR APRR SA, 1.250%, 18/01/28	282 072	0,03	500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.375%, 16/07/28	464 495	0,05
400 000	EUR APRR SA, 0.010%, 19/06/28	353 700	0,04	400 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.250%, 19/07/28	346 256	0,04
400 000	EUR APRR SA, 3.125%, perpetual	403 152	0,05	500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.625%, 03/11/28	437 350	0,05
200 000	EUR Argan SA, 1.011%, 17/11/26	178 640	0,02	500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.125%, 13/03/29	519 020	0,06
600 000	EUR Arkema SA, 1.500%, 20/01/25	587 070	0,07	300 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.750%, 15/03/29	274 488	0,03
100 000	EUR Arkema SA, 4.250%, 20/05/30	104 400	0,01	300 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.625%, 06/11/29	285 066	0,03
100 000	EUR Arkema SA, 3.500%, 23/01/31	100 206	0,01	200 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.000%, 21/11/29	207 150	0,02
500 000	EUR Arval Service Lease SA, 0.875%, 17/02/25	483 385	0,06	300 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.750%, 17/01/30	253 926	0,03
200 000	EUR Arval Service Lease SA, 0.010%, 01/10/25	188 084	0,02	300 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.125%, 18/09/30	315 024	0,04
200 000	EUR Arval Service Lease SA, 3.375%, 04/01/26	199 794	0,02	300 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.625%, 21/02/31	245 544	0,03
200 000	EUR Arval Service Lease SA, 4.750%, 22/05/27	207 514	0,02	200 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.125%, 19/11/31	161 712	0,02
400 000	EUR Arval Service Lease SA, 4.250%, perpetual	404 536	0,05	300 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.125%, 19/01/32	250 047	0,03
300 000	EUR Autoroutes du Sud de la France SA, 1.125%, 20/04/26	287 892	0,03	300 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.625%, 14/09/32	303 864	0,04
300 000	EUR Autoroutes du Sud de la France SA, 1.000%, 13/05/26	286 617	0,03	400 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.125%, 13/01/33	428 248	0,05
800 000	EUR Autoroutes du Sud de la France SA, 1.250%, 18/01/27	763 320	0,09	500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.000%, 26/01/33	513 175	0,06
500 000	EUR Autoroutes du Sud de la France SA, 1.375%, 27/06/28	471 275	0,06	500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.750%, 01/02/33	510 390	0,06
750 000	EUR AXA SA, 3.750%, 12/10/30	790 950	0,09	500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.125%, 14/06/33	524 505	0,06
200 000	EUR AXA SA, 3.625%, 10/01/33	211 732	0,03	900 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.375%, perpetual	934 641	0,11
800 000	EUR AXA SA, 1.375%, 07/10/41	660 768	0,08	200 000	EUR Banque Stellantis France SACA, 0.010%, 22/01/25	192 338	0,02
800 000	EUR AXA SA, 1.875%, 10/07/42	657 976	0,08	300 000	EUR Banque Stellantis France SACA, 3.875%, 19/01/26	302 226	0,04
500 000	EUR AXA SA, 4.250%, 10/03/43	493 700	0,06	200 000	EUR Banque Stellantis France SACA, 4.000%, 21/01/27	203 334	0,02
400 000	EUR AXA SA, 3.375%, 06/07/47	391 600	0,05	300 000	EUR BNP Paribas Cardif SA, 4.032%, perpetual	295 620	0,04
310 000	EUR AXA SA, 5.500%, perpetual	332 004	0,04	410 000	EUR BNP Paribas SA, 1.500%, 17/11/25	397 356	0,05
200 000	EUR AXA SA, 3.875%, perpetual	197 342	0,02	410 000	EUR BNP Paribas SA, 1.125%, 11/06/26	390 287	0,05
600 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.010%, 07/03/25	574 878	0,07	200 000	EUR BNP Paribas SA, 0.125%, 04/09/26	184 572	0,02
500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.000%, 23/05/25	483 165	0,06	400 000	EUR BNP Paribas SA, 2.250%, 11/01/27	388 660	0,05
1 200 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.750%, 17/07/25	1 150 956	0,14	400 000	EUR BNP Paribas SA, 2.250%, 11/01/27	388 660	0,05
1 000 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.625%, 19/01/26	966 700	0,11	1 400 000	EUR BNP Paribas SA, 2.125%, 23/01/27	1 360 156	0,16
500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.010%, 11/05/26	464 590	0,05	500 000	EUR BNP Paribas SA, 0.250%, 13/04/27	464 005	0,05
600 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.750%, 08/06/26	564 684	0,07				
100 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.125%, 12/09/26	96 619	0,01				
400 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.875%, 04/11/26	382 860	0,05				
400 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.250%, 26/05/27	375 188	0,04				
900 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.125%, 14/09/27	896 949	0,11				
500 000	EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.875%, 26/01/28	507 375	0,06				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
400 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.375%, 14/10/27	369 004	0,04	300 000 EUR	BPCE SA, 0.500%, 14/01/28	273 834	0,03
400 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 19/02/28	363 988	0,04	400 000 EUR	BPCE SA, 3.500%, 25/01/28	404 416	0,05
270 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.500%, 23/05/28	253 076	0,03	700 000 EUR	BPCE SA, 4.125%, 10/07/28	725 942	0,09
400 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 30/05/28	362 184	0,04	300 000 EUR	BPCE SA, 4.375%, 13/07/28	310 128	0,04
500 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.750%, 25/07/28	486 880	0,06	300 000 EUR	BPCE SA, 1.000%, 05/10/28	274 155	0,03
300 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.375%, 13/01/29	310 596	0,04	300 000 EUR	BPCE SA, 0.625%, 15/01/30	256 905	0,03
1 900 000 EUR	BNP Paribas SA, 3.875%, 23/02/29	1 950 125	0,23	300 000 EUR	BPCE SA, 4.625%, 02/03/30	313 500	0,04
500 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.125%, 17/04/29	451 330	0,05	500 000 EUR	BPCE SA, 0.250%, 14/01/31	402 550	0,05
200 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.375%, 28/05/29	179 864	0,02	300 000 EUR	BPCE SA, 1.000%, 14/01/32	247 389	0,03
500 000 EUR	BNP Paribas SA, 3.625%, 01/09/29	501 830	0,06	100 000 EUR	BPCE SA, 2.375%, 26/04/32	92 967	0,01
300 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 19/01/30	257 286	0,03	500 000 EUR	BPCE SA, 4.000%, 29/11/32	522 370	0,06
1 000 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.875%, 11/07/30	861 900	0,10	400 000 EUR	BPCE SA, 4.500%, 13/01/33	420 352	0,05
300 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.375%, 20/11/30	291 312	0,03	600 000 EUR	BPCE SA, 4.750%, 14/06/34	638 040	0,08
400 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.625%, 02/07/31	341 600	0,04	500 000 EUR	BPCE SA, 3.625%, perpetual	504 300	0,06
900 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.125%, 15/01/32	820 683	0,10	600 000 EUR	BPCE SA, 5.750%, perpetual	634 146	0,07
500 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.500%, 31/03/32	473 225	0,06	400 000 EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 6.000%, 23/01/27	429 744	0,05
500 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.100%, 07/04/32	446 590	0,05	200 000 EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 3.375%, 24/09/28	198 360	0,02
500 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.125%, 26/09/32	523 710	0,06	300 000 EUR	Capgemini SE, 0.625%, 23/06/25	288 201	0,03
100 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.875%, 31/08/33	85 816	0,01	400 000 EUR	Capgemini SE, 1.625%, 15/04/26	387 352	0,05
800 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.250%, perpetual	827 320	0,10	200 000 EUR	Capgemini SE, 1.750%, 18/04/28	190 750	0,02
400 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.125%, perpetual	421 720	0,05	300 000 EUR	Capgemini SE, 1.125%, 23/06/30	267 885	0,03
100 000 EUR	Bouygues SA, 1.375%, 07/06/27	95 220	0,01	400 000 EUR	Capgemini SE, 2.375%, 15/04/32	378 904	0,04
300 000 EUR	Bouygues SA, 1.125%, 24/07/28	279 552	0,03	100 000 EUR	Carmila SA, 1.625%, 30/05/27	92 449	0,01
600 000 EUR	Bouygues SA, 2.250%, 29/06/29	580 008	0,07	200 000 EUR	Carmila SA, 2.125%, 07/03/28	185 394	0,02
500 000 EUR	Bouygues SA, 0.500%, 11/02/30	433 970	0,05	200 000 EUR	Carmila SA, 5.500%, 09/10/28	207 504	0,02
600 000 EUR	Bouygues SA, 4.625%, 07/06/32	659 142	0,08	200 000 EUR	Carrefour Banque SA, 4.079%, 05/05/27	203 084	0,02
300 000 EUR	Bouygues SA, 3.250%, 30/06/37	293 514	0,03	550 000 EUR	Carrefour SA, 1.250%, 03/06/25	533 555	0,06
700 000 EUR	Bouygues SA, 5.375%, 30/06/42	831 663	0,10	300 000 EUR	Carrefour SA, 1.750%, 04/05/26	290 970	0,03
300 000 EUR	BPCE SA, 1.000%, 01/04/25	290 667	0,03	300 000 EUR	Carrefour SA, 1.875%, 30/10/26	289 998	0,03
300 000 EUR	BPCE SA, 0.625%, 28/04/25	288 870	0,03	200 000 EUR	Carrefour SA, 1.000%, 17/05/27	186 828	0,02
400 000 EUR	BPCE SA, 0.250%, 15/01/26	375 960	0,04	200 000 EUR	Carrefour SA, 4.125%, 12/10/28	208 100	0,02
300 000 EUR	BPCE SA, 0.375%, 02/02/26	282 792	0,03	600 000 EUR	Carrefour SA, 2.375%, 30/10/29	575 022	0,07
700 000 EUR	BPCE SA, 0.010%, 14/01/27	638 043	0,08	300 000 EUR	Carrefour SA, 3.750%, perpetual	306 231	0,04
300 000 EUR	BPCE SA, 1.750%, 26/04/27	287 184	0,03	200 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.625%, 10/08/25	194 722	0,02
700 000 EUR	BPCE SA, 0.500%, 15/09/27	645 806	0,08	300 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.750%, 29/11/26	305 007	0,04
				100 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.375%, 14/06/27	94 834	0,01
				200 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 2.125%, 10/06/28	192 140	0,02
				500 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.875%, 21/09/28	475 635	0,06
				300 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.500%, 18/01/29	306 375	0,04
				300 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.875%, 29/11/30	310 011	0,04
				800 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.875%, 15/03/31	738 336	0,09

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
400 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 2.625%, 10/08/32	383 988	0,05	800 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.250%, 11/07/29	825 376	0,10
200 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.010%, 02/11/28	176 406	0,02	400 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.500%, 29/08/29	385 620	0,05
300 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 1.750%, 03/09/30	280 179	0,03	400 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.500%, 21/09/29	348 988	0,04
200 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.250%, 02/11/32	160 664	0,02	300 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.125%, 07/03/30	313 341	0,04
300 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 2.500%, 03/09/38	280 092	0,03	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.625%, 05/06/30	193 248	0,02
200 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.625%, 02/11/40	135 608	0,02	400 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.125%, 12/07/32	335 268	0,04
100 000 EUR	Coface SA, 6.000%, 22/09/32	106 736	0,01	900 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.000%, 18/01/33	946 548	0,11
100 000 EUR	Coface SA, 5.750%, 28/11/33	103 699	0,01	300 000 EUR	Credit Agricole SA, 5.500%, 28/08/33	315 000	0,04
600 000 EUR	Cofiroute SA, 0.375%, 07/02/25	579 870	0,07	400 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.375%, 27/11/33	420 056	0,05
600 000 EUR	Cofiroute SA, 0.750%, 09/09/28	549 930	0,06	800 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.500%, 22/04/34	735 392	0,09
300 000 EUR	Cofiroute SA, 1.000%, 19/05/31	259 800	0,03	400 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.875%, 28/11/34	418 824	0,05
300 000 EUR	Covivio Hotels SACA, 1.875%, 24/09/25	289 326	0,03	800 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.875%, perpetual	826 800	0,10
300 000 EUR	Covivio SA, 1.500%, 21/06/27	281 787	0,03	300 000 EUR	Credit Logement SA, 1.081%, 15/02/34	260 778	0,03
600 000 EUR	Covivio SA, 4.625%, 05/06/32	621 702	0,07	200 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.010%, 28/01/26	187 330	0,02
200 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 5.875%, 25/10/33	219 738	0,03	400 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.625%, 15/04/26	384 704	0,05
300 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 2.625%, 29/01/48	278 871	0,03	200 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.375%, 19/09/27	200 822	0,02
800 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 4.750%, 27/09/48	806 144	0,09	700 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.875%, 22/05/28	715 393	0,08
300 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 4.500%, perpetual	298 611	0,04	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.375%, 03/10/28	87 515	0,01
500 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 4.250%, perpetual	497 165	0,06	400 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.500%, 09/02/29	395 252	0,05
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.375%, 21/10/25	190 602	0,02	200 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.750%, 18/01/30	171 884	0,02
500 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.000%, 22/04/26	482 450	0,06	200 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 4.125%, 02/04/31	209 564	0,03
300 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.000%, 12/10/26	302 454	0,04	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.875%, 25/10/31	82 162	0,01
500 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.875%, 20/12/26	481 355	0,06	300 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 4.250%, 01/12/32	315 306	0,04
1 020 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.625%, 17/03/27	989 410	0,12	300 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.875%, 11/03/33	238 380	0,03
600 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.875%, 22/04/27	578 628	0,07	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 4.125%, 01/02/34	105 126	0,01
300 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.375%, 28/07/27	302 100	0,04	300 000 EUR	Danone SA, 0.010%, 01/12/25	283 254	0,03
300 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.125%, 09/12/27	266 166	0,03	500 000 EUR	Danone SA, 0.571%, 17/03/27	469 130	0,06
400 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.625%, 12/01/28	367 836	0,04	400 000 EUR	Danone SA, 0.395%, 10/06/29	351 524	0,04
300 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.375%, 20/04/28	265 041	0,03	500 000 EUR	Danone SA, 3.071%, 07/09/32	498 065	0,06
300 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.125%, 24/02/29	273 255	0,03	200 000 EUR	Danone SA, 3.470%, perpetual	205 342	0,02
500 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.750%, 05/03/29	461 785	0,05	200 000 EUR	Danone SA, 1.000%, perpetual	182 746	0,02
400 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.000%, 25/03/29	370 876	0,04				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
700 000 EUR	Dassault Systemes SE, 0.125%, 16/09/26	652 379	0,08	300 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2.500%, 4/05/27	291 207	0,03
200 000 EUR	Edenred SE, 1.375%, 10/03/25	195 040	0,02	400 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.625%, 27/11/27	374 968	0,04
100 000 EUR	Edenred SE, 1.875%, 06/03/26	97 382	0,01	300 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.625%, 18/09/29	269 724	0,03
300 000 EUR	Edenred SE, 3.625%, 13/12/26	304 128	0,04	200 000 EUR	Edenred SE, 1.375%, 18/06/29	183 936	0,02
200 000 EUR	Edenred SE, 1.875%, 30/03/27	192 932	0,02	200 000 EUR	Edenred SE, 3.625%, 13/06/31	203 468	0,02
200 000 EUR	Edenred SE, 1.375%, 18/06/29	183 936	0,02	200 000 EUR	Elo Saca, 4.875%, 08/12/28	198 028	0,02
200 000 EUR	Edenred SE, 3.625%, 13/06/31	203 468	0,02	500 000 EUR	ELO SACA, 2.375%, 25/04/25	488 165	0,06
200 000 EUR	Elo Saca, 4.875%, 08/12/28	198 028	0,02	300 000 EUR	ELO SACA, 6.000%, 22/03/29	304 818	0,04
500 000 EUR	ELO SACA, 2.375%, 25/04/25	488 165	0,06	1 000 000 EUR	Engie SA, 2.375%, 19/05/26	979 730	0,12
300 000 EUR	ELO SACA, 6.000%, 22/03/29	304 818	0,04	200 000 EUR	Engie SA, 3.625%, 06/12/26	202 822	0,02
1 000 000 EUR	Engie SA, 2.375%, 19/05/26	979 730	0,12	100 000 EUR	Engie SA, 0.010%, 04/03/27	90 864	0,01
200 000 EUR	Engie SA, 3.625%, 06/12/26	202 822	0,02	600 000 EUR	Engie SA, 0.375%, 11/06/27	548 136	0,06
100 000 EUR	Engie SA, 0.010%, 04/03/27	90 864	0,01	200 000 EUR	Engie SA, 3.750%, 06/09/27	204 082	0,02
600 000 EUR	Engie SA, 0.375%, 11/06/27	548 136	0,06	200 000 EUR	Engie SA, 1.375%, 22/06/28	186 056	0,02
200 000 EUR	Engie SA, 3.750%, 06/09/27	204 082	0,02	400 000 EUR	Engie SA, 3.500%, 27/09/29	406 904	0,05
200 000 EUR	Engie SA, 1.375%, 22/06/28	186 056	0,02	800 000 EUR	Engie SA, 3.625%, 11/01/30	821 592	0,10
400 000 EUR	Engie SA, 3.500%, 27/09/29	406 904	0,05	300 000 EUR	Engie SA, 3.875%, 06/01/31	310 095	0,04
800 000 EUR	Engie SA, 3.625%, 11/01/30	821 592	0,10	300 000 EUR	Engie SA, 1.875%, 19/09/33	264 990	0,03
300 000 EUR	Engie SA, 3.875%, 06/01/31	310 095	0,04	300 000 EUR	Engie SA, 3.875%, 06/12/33	310 095	0,04
300 000 EUR	Engie SA, 1.875%, 19/09/33	264 990	0,03	300 000 EUR	Engie SA, 4.250%, 06/09/34	318 090	0,04
300 000 EUR	Engie SA, 3.875%, 06/12/33	310 095	0,04	800 000 EUR	Engie SA, 4.000%, 11/01/35	831 112	0,10
300 000 EUR	Engie SA, 4.250%, 06/09/34	318 090	0,04	300 000 EUR	Engie SA, 1.500%, 13/03/35	243 948	0,03
800 000 EUR	Engie SA, 4.000%, 11/01/35	831 112	0,10	600 000 EUR	Engie SA, 1.375%, 21/06/39	435 390	0,05
300 000 EUR	Engie SA, 1.500%, 13/03/35	243 948	0,03	300 000 EUR	Engie SA, 4.500%, 06/09/42	323 115	0,04
600 000 EUR	Engie SA, 1.375%, 21/06/39	435 390	0,05	300 000 EUR	Engie SA, 4.250%, 11/01/43	314 037	0,04
300 000 EUR	Engie SA, 4.500%, 06/09/42	323 115	0,04	400 000 EUR	Engie SA, 1.875%, 31/12/99	331 912	0,04
300 000 EUR	Engie SA, 4.250%, 11/01/43	314 037	0,04	110 000 EUR	Engie SA, 5.950%, 16/03/11	140 263	0,02
400 000 EUR	Engie SA, 1.875%, 31/12/99	331 912	0,04	400 000 EUR	Engie SA, 1.500%, perpetual	352 324	0,04
110 000 EUR	Engie SA, 5.950%, 16/03/11	140 263	0,02	600 000 EUR	Engie SA, 3.250%, perpetual	591 744	0,07
400 000 EUR	Engie SA, 1.500%, perpetual	352 324	0,04	400 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.125%, 27/05/25	382 340	0,05
600 000 EUR	Engie SA, 3.250%, perpetual	591 744	0,07	600 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.375%, 05/01/26	569 712	0,07
400 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.125%, 27/05/25	382 340	0,05	500 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.375%, 27/11/27	457 330	0,05
600 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.375%, 05/01/26	569 712	0,07	500 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.500%, 05/06/28	456 110	0,05
500 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.375%, 27/11/27	457 330	0,05	200 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.750%, 27/11/31	172 490	0,02
500 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.500%, 05/06/28	456 110	0,05	300 000 EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.750%, 30/04/30	277 827	0,03
200 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.750%, 27/11/31	172 490	0,02	100 000 EUR	Gecina SA, 1.375%, 30/06/27	95 220	0,01
300 000 EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.750%, 30/04/30	277 827	0,03	500 000 EUR	Gecina SA, 1.000%, 30/01/29	455 160	0,05
100 000 EUR	Gecina SA, 1.375%, 30/06/27	95 220	0,01	300 000 EUR	Gecina SA, 1.625%, 14/03/30	277 899	0,03
500 000 EUR	Gecina SA, 1.000%, 30/01/29	455 160	0,05	400 000 EUR	Gecina SA, 2.000%, 30/06/32	368 960	0,04
300 000 EUR	Gecina SA, 1.625%, 14/03/30	277 899	0,03	400 000 EUR	Gecina SA, 1.625%, 29/05/34	347 576	0,04
400 000 EUR	Gecina SA, 2.000%, 30/06/32	368 960	0,04	500 000 EUR	Groupe VYV, 1.625%, 02/07/29	452 300	0,05
400 000 EUR	Gecina SA, 1.625%, 29/05/34	347 576	0,04	100 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2.250%, 24/03/25	98 030	0,01
500 000 EUR	Groupe VYV, 1.625%, 02/07/29	452 300	0,05				
100 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2.250%, 24/03/25	98 030	0,01				
				300 000 EUR	Legrand SA, 1.000%, 06/03/26	866 043	0,10
				100 000 EUR	Legrand SA, 1.875%, 16/12/27	95 968	0,01
				300 000 EUR	Legrand SA, 0.625%, 24/06/28	274 188	0,03
				300 000 EUR	Legrand SA, 3.500%, 29/05/29	309 972	0,04
				200 000 EUR	Legrand SA, 0.375%, 06/10/31	167 138	0,02
				100 000 EUR	Legrand SA, 1.875%, 06/07/32	93 532	0,01

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
600 000 EUR	L'Oreal SA, 0.875%, 29/06/26	572 076	0,07	200 000 EUR	Pernod Ricard SA, 0.875%, 24/10/31	170 808	0,02
500 000 EUR	L'Oreal SA, 2.875%, 19/05/28	502 530	0,06	300 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.750%, 02/11/32	314 217	0,04
600 000 EUR	L'Oreal SA, 3.125%, perpetual	599 082	0,07	300 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.750%, 15/09/33	312 546	0,04
500 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.750%, 07/04/25	484 885	0,06	200 000 EUR	Praemia Healthcare SACA, 5.500%, 19/09/28	209 516	0,03
700 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.010%, 11/02/26	659 883	0,08	200 000 EUR	Praemia Healthcare SACA, 1.375%, 17/09/30	165 058	0,02
400 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.125%, 11/02/28	361 640	0,04	200 000 EUR	PSA Tresorerie GIE, 6.000%, 19/09/33	236 348	0,03
400 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.250%, 07/09/29	407 364	0,05	500 000 EUR	RCI Banque SA, 4.125%, 01/12/25	503 610	0,06
500 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.500%, 07/09/33	516 405	0,06	280 000 EUR	RCI Banque SA, 1.750%, 10/04/26	268 929	0,03
600 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.375%, perpetual	603 930	0,07	800 000 EUR	RCI Banque SA, 4.625%, 13/07/26	817 808	0,10
100 000 EUR	Mercialys SA, 1.800%, 27/02/26	95 559	0,01	270 000 EUR	RCI Banque SA, 4.625%, 02/10/26	277 025	0,03
500 000 EUR	Mercialys SA, 2.500%, 28/02/29	456 405	0,05	500 000 EUR	RCI Banque SA, 4.500%, 06/04/27	513 645	0,06
200 000 EUR	Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal, 0.625%, 21/06/27	181 258	0,02	400 000 EUR	RCI Banque SA, 4.875%, 14/06/28	420 940	0,05
500 000 EUR	Nerval SAS, 3.625%, 20/07/28	496 975	0,06	272 000 EUR	RCI Banque SA, 4.875%, 02/10/29	286 038	0,03
300 000 EUR	Nerval SAS, 2.875%, 14/04/32	270 087	0,03	400 000 EUR	SANEF SA, 1.875%, 16/03/26	387 420	0,05
300 000 EUR	Orange SA, 1.000%, 12/05/25	290 469	0,03	900 000 EUR	Sanofi SA, 1.000%, 01/04/25	874 242	0,10
400 000 EUR	Orange SA, 1.000%, 12/09/25	385 560	0,05	600 000 EUR	Sanofi SA, 1.500%, 22/09/25	584 664	0,07
600 000 EUR	Orange SA, 0.010%, 29/06/26	558 690	0,07	300 000 EUR	Sanofi SA, 1.000%, 21/03/26	288 225	0,03
300 000 EUR	Orange SA, 1.250%, 07/07/27	284 241	0,03	500 000 EUR	Sanofi SA, 1.750%, 10/09/26	486 690	0,06
500 000 EUR	Orange SA, 1.500%, 09/09/27	479 560	0,06	900 000 EUR	Sanofi SA, 0.500%, 13/01/27	844 551	0,10
100 000 EUR	Orange SA, 1.375%, 20/03/28	94 276	0,01	600 000 EUR	Sanofi SA, 1.125%, 05/04/28	563 646	0,07
400 000 EUR	Orange SA, 1.375%, 16/01/30	367 640	0,04	200 000 EUR	Sanofi SA, 0.875%, 21/03/29	182 852	0,02
400 000 EUR	Orange SA, 1.875%, 12/09/30	375 456	0,04	200 000 EUR	Sanofi SA, 1.250%, 06/04/29	186 136	0,02
300 000 EUR	Orange SA, 3.625%, 16/11/31	313 041	0,04	200 000 EUR	Sanofi SA, 1.250%, 21/03/34	173 950	0,02
400 000 EUR	Orange SA, 2.375%, 18/05/32	383 484	0,05	350 000 EUR	Schlumberger Finance France SAS, 1.000%, 18/02/26	334 932	0,04
500 000 EUR	Orange SA, 0.500%, 04/09/32	407 950	0,05	400 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.375%, 06/04/25	400 284	0,05
857 000 EUR	Orange SA, 8.125%, 28/01/33	1 201 600	0,14	100 000 EUR	Schneider Electric SE, 0.875%, 13/12/26	95 170	0,01
100 000 EUR	Orange SA, 1.200%, 11/07/34	83 156	0,01	200 000 EUR	Schneider Electric SE, 1.000%, 09/04/27	189 418	0,02
200 000 EUR	Orange SA, 3.875%, 11/09/35	212 806	0,03	300 000 EUR	Schneider Electric SE, 1.375%, 21/06/27	286 134	0,03
410 000 EUR	Orange SA, 5.000%, perpetual	418 495	0,05	300 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.250%, 12/06/28	306 285	0,04
600 000 EUR	Orange SA, 1.375%, perpetual	511 530	0,06	500 000 EUR	Schneider Electric SE, 0.250%, 11/03/29	440 945	0,05
400 000 EUR	Orange SA, 1.750%, perpetual	354 708	0,04	200 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.125%, 13/10/29	203 674	0,02
300 000 EUR	Orange SA, 2.375%, perpetual	291 708	0,03	500 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.500%, 12/06/33	519 465	0,06
300 000 EUR	Orange SA, 5.375%, perpetual	314 211	0,04	600 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.375%, 13/04/34	617 586	0,07
500 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.500%, 18/05/26	485 340	0,06				
300 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.750%, 15/09/27	307 689	0,04				
200 000 EUR	Pernod Ricard SA, 0.500%, 24/10/27	183 946	0,02				
200 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.250%, 02/11/28	203 030	0,02				
200 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.375%, 07/04/29	185 206	0,02				
300 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.750%, 08/04/30	278 376	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
200 000 EUR	SCOR SE, 3.000%, 08/06/46	194 330	0,02	700 000 EUR	Societe Generale SA, 5.625%, 02/06/33	746 333	0,09
200 000 EUR	SCOR SE, 3.625%, 27/05/48	196 902	0,02	280 000 EUR	Sodexo SA, 0.750%, 27/04/25	270 556	0,03
200 000 EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, 1.500%, 29/05/25	194 562	0,02	320 000 EUR	Sodexo SA, 0.750%, 14/04/27	303 491	0,04
200 000 EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, 1.500%, 05/06/27	191 552	0,02	190 000 EUR	Sodexo SA, 1.000%, 17/07/28	174 652	0,02
300 000 EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, 0.500%, 21/04/28	269 142	0,03	355 000 EUR	Sodexo SA, 1.000%, 27/04/29	322 482	0,04
600 000 EUR	Societe Generale SA, 2.625%, 27/02/25	591 186	0,07	300 000 EUR	Sogecap SA, 6.500%, 16/05/44	323 847	0,04
400 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 24/02/26	374 640	0,04	100 000 EUR	Stellantis NV, 2.000%, 20/03/25	98 065	0,01
200 000 EUR	Societe Generale SA, 1.125%, 21/04/26	193 042	0,02	300 000 EUR	Stellantis NV, 2.750%, 15/05/26	296 703	0,04
200 000 EUR	Societe Generale SA, 0.875%, 01/07/26	187 924	0,02	300 000 EUR	Suez SACA, 1.875%, 24/05/27	286 980	0,03
500 000 EUR	Societe Generale SA, 4.250%, 28/09/26	512 535	0,06	600 000 EUR	Suez SACA, 4.625%, 03/11/28	635 616	0,08
600 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 17/11/26	563 238	0,07	300 000 EUR	Suez SACA, 5.000%, 03/11/32	331 635	0,04
700 000 EUR	Societe Generale SA, 4.125%, 02/06/27	718 088	0,08	100 000 EUR	Suez SACA, 4.500%, 13/11/33	106 680	0,01
300 000 EUR	Societe Generale SA, 4.000%, 16/11/27	307 146	0,04	300 000 EUR	Suez SACA, 2.875%, 24/05/34	279 669	0,03
700 000 EUR	Societe Generale SA, 0.625%, 02/12/27	641 725	0,08	400 000 EUR	TDF Infrastructure SASU, 2.500%, 07/04/26	390 108	0,05
300 000 EUR	Societe Generale SA, 1.375%, 13/01/28	278 244	0,03	300 000 EUR	TDF Infrastructure SASU, 1.750%, 01/12/29	261 969	0,03
400 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 18/02/28	353 296	0,04	100 000 EUR	Teleperformance SE, 1.875%, 02/07/25	96 902	0,01
400 000 EUR	Societe Generale SA, 2.125%, 27/09/28	377 896	0,04	200 000 EUR	Teleperformance SE, 3.750%, 24/06/29	199 314	0,02
200 000 EUR	Societe Generale SA, 4.125%, 21/11/28	207 142	0,02	100 000 EUR	Teleperformance SE, 5.750%, 22/11/31	106 237	0,01
900 000 EUR	Societe Generale SA, 1.750%, 22/03/29	817 893	0,10	200 000 EUR	Tikehau Capital SCA, 2.250%, 14/10/26	192 444	0,02
300 000 EUR	Societe Generale SA, 2.625%, 30/05/29	291 735	0,03	400 000 EUR	Tikehau Capital SCA, 1.625%, 31/03/29	345 768	0,04
400 000 EUR	Societe Generale SA, 0.875%, 24/09/29	342 164	0,04	200 000 EUR	Tikehau Capital SCA, 6.625%, 14/03/30	218 306	0,03
400 000 EUR	Societe Generale SA, 4.750%, 28/09/29	416 832	0,05	1 100 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.375%, 19/03/25	1 071 279	0,13
300 000 EUR	Societe Generale SA, 1.250%, 12/06/30	258 012	0,03	900 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 2.875%, 19/11/25	895 842	0,11
300 000 EUR	Societe Generale SA, 1.000%, 24/11/30	281 388	0,03	500 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.491%, 08/04/27	477 980	0,06
700 000 EUR	Societe Generale SA, 4.250%, 06/12/30	711 515	0,08	800 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.375%, 04/10/29	735 392	0,09
500 000 EUR	Societe Generale SA, 1.125%, 30/06/31	459 705	0,05	200 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.491%, 04/09/30	182 552	0,02
100 000 EUR	Societe Generale SA, 4.875%, 21/11/31	104 582	0,01	100 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.952%, 18/05/31	86 978	0,01
200 000 EUR	Societe Generale SA, 5.250%, 06/09/32	207 582	0,02	500 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.994%, 08/04/32	462 870	0,05
300 000 EUR	Societe Generale SA, 4.250%, 16/11/32	318 981	0,04	400 000 EUR	TotalEnergies SE, 2.000%, 31/12/99	337 528	0,04
				1 070 000 EUR	TotalEnergies SE, 2.625%, perpetual	1 045 657	0,12
				640 000 EUR	TotalEnergies SE, 3.369%, perpetual	623 450	0,07
				500 000 EUR	TotalEnergies SE, 1.625%, perpetual	447 530	0,05
				300 000 EUR	TotalEnergies SE, 2.000%, perpetual	276 738	0,03
				350 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0.875%, 21/02/25	338 789	0,04

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.125%, 09/04/25	196 120	0,02	200 000 EUR	Worldline SA, 4.125%, 12/09/28	197 860	0,02
300 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.125%, 15/09/25	289 083	0,03	290 000 EUR	WPP Finance SA, 2.375%, 19/05/27	284 360	0,03
410 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.375%, 09/03/26	393 362	0,05	340 000 EUR	WPP Finance SA, 4.125%, perpetual	350 707	0,04
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.500%, 29/05/29	181 652	0,02	France – Total			178 413 480
400 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 4.125%, 11/12/30	412 748	0,05	Allemagne			
500 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.875%, 15/01/31	449 040	0,05	500 000 EUR	Aareal Bank AG, 4.500%, 25/07/25	501 135	0,06
1 000 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0.875%, 29/03/32	799 590	0,09	200 000 EUR	Aareal Bank AG, 0.500%, 07/04/27	176 984	0,02
500 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.000%, 29/06/32	442 905	0,05	300 000 EUR	Aareal Bank AG, 0.250%, 23/11/27	256 269	0,03
700 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.375%, 25/05/33	575 680	0,07	400 000 EUR	adidas AG, 3.000%, 21/11/25	400 436	0,05
600 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.750%, 27/02/34	510 138	0,06	200 000 EUR	adidas AG, 3.125%, 21/11/29	203 544	0,02
480 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.000%, 28/04/36	400 320	0,05	290 000 EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.125%, 25/11/25	277 797	0,03
280 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.000%, 29/05/37	229 309	0,03	100 000 EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.625%, 25/11/28	91 312	0,01
300 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.250%, 14/05/38	246 264	0,03	600 000 EUR	Allianz SE, 4.597%, 07/09/38	614 766	0,07
500 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.750%, 10/09/25	487 750	0,06	500 000 EUR	Allianz SE, 2.241%, 07/07/45	485 195	0,06
400 000 EUR	Veolia Environnement SA, 0.010%, 09/06/26	371 828	0,04	400 000 EUR	Allianz SE, 1.301%, 25/09/49	345 140	0,04
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 0.010%, 14/01/27	182 814	0,02	800 000 EUR	Allianz SE, 2.121%, 08/07/50	704 944	0,08
1 100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 4.625%, 30/03/27	1 155 869	0,14	800 000 EUR	Allianz SE, 4.252%, 05/07/52	792 552	0,09
300 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.250%, 02/04/27	284 367	0,03	400 000 EUR	alstria office REIT-AG, 0.500%, 26/09/25	345 288	0,04
300 000 EUR	Veolia Environnement SA, 0.927%, 04/01/29	271 824	0,03	100 000 EUR	alstria office REIT-AG, 1.500%, 23/06/26	81 669	0,01
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.625%, 17/09/30	91 209	0,01	200 000 EUR	alstria office REIT-AG, 1.500%, 15/11/27	149 444	0,02
400 000 EUR	Veolia Environnement SA, 0.500%, 14/10/31	331 136	0,04	200 000 EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 0.750%, 04/05/26	189 662	0,02
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.625%, 21/09/32	177 266	0,02	480 000 EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 2.000%, 08/10/28	462 811	0,05
450 000 EUR	Veolia Environnement SA, 6.125%, 25/11/33	559 480	0,07	700 000 EUR	Amprion GmbH, 3.450%, 22/09/27	707 889	0,08
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.250%, 14/05/35	162 892	0,02	300 000 EUR	Amprion GmbH, 3.875%, 07/09/28	309 408	0,04
300 000 EUR	Verallia SA, 1.625%, 14/05/28	280 017	0,03	300 000 EUR	Amprion GmbH, 3.971%, 22/09/32	312 528	0,04
300 000 EUR	Verallia SA, 1.875%, 10/11/31	263 283	0,03	300 000 EUR	Amprion GmbH, 4.125%, 07/09/34	315 663	0,04
200 000 EUR	Vinci SA, 0.010%, 27/11/28	175 568	0,02	200 000 EUR	BASF SE, 0.875%, 22/05/25	194 024	0,02
300 000 EUR	Vinci SA, 1.625%, 18/01/29	282 957	0,03	500 000 EUR	BASF SE, 0.750%, 17/03/26	475 045	0,06
400 000 EUR	Vinci SA, 1.750%, 26/09/30	371 752	0,04	200 000 EUR	BASF SE, 4.000%, 08/03/29	208 896	0,03
200 000 EUR	Vinci SA, 3.375%, 17/10/32	203 596	0,02	200 000 EUR	BASF SE, 1.500%, 22/05/30	183 976	0,02
500 000 EUR	Vivendi SE, 0.625%, 11/06/25	480 915	0,06	300 000 EUR	BASF SE, 1.500%, 17/03/31	270 225	0,03
500 000 EUR	Vivendi SE, 1.125%, 11/12/28	474 010	0,06	200 000 EUR	BASF SE, 0.875%, 06/10/31	172 558	0,02
200 000 EUR	Wendel SE, 4.500%, 19/06/30	206 582	0,02	200 000 EUR	BASF SE, 4.250%, 08/03/32	213 044	0,03
				800 000 EUR	BASF SE, 3.750%, 29/06/32	828 496	0,10
				200 000 EUR	BASF SE, 4.500%, 08/03/35	217 376	0,03
				550 000 EUR	BASF SE, 1.625%, 15/11/37	455 779	0,05
				700 000 EUR	Berlin Hyp AG, 1.250%, 22/01/25	677 579	0,08
				100 000 EUR	Berlin Hyp AG, 1.000%, 05/02/26	94 837	0,01
				300 000 EUR	Berlin Hyp AG, 1.125%, 25/10/27	274 629	0,03
				300 000 EUR	Berlin Hyp AG, 1.500%, 18/04/28	274 641	0,03
				100 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 1.125%, 27/04/26	96 019	0,01

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
600 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 3.500%, 29/05/29	607 914	0,07	150 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.625%, 08/10/25	146 797	0,02
600 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 1.500%, 15/05/30	541 236	0,06	200 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.625%, 22/02/26	187 892	0,02
300 000 EUR	Clearstream Banking AG, 0.010%, 01/12/25	283 968	0,03	600 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 3.875%, 28/09/26	613 098	0,07
300 000 EUR	Commerzbank AG, 1.125%, 19/09/25	288 822	0,03	265 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.125%, 26/03/28	249 569	0,03
1 190 000 EUR	Commerzbank AG, 1.000%, 04/03/26	1 136 855	0,13	300 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 3.750%, 28/09/29	312 006	0,04
200 000 EUR	Commerzbank AG, 0.750%, 24/03/26	191 994	0,02	300 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.500%, 04/04/32	272 115	0,03
200 000 EUR	Commerzbank AG, 1.125%, 22/06/26	189 546	0,02	400 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 3.875%, 28/09/33	425 632	0,05
100 000 EUR	Commerzbank AG, 0.875%, 22/01/27	92 920	0,01	500 000 EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.100%, 02/02/26	447 915	0,05
300 000 EUR	Commerzbank AG, 0.375%, 01/09/27	274 326	0,03	500 000 EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 4.375%, 28/08/26	493 725	0,06
500 000 EUR	Commerzbank AG, 3.000%, 14/09/27	489 460	0,06	100 000 EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 5.000%, 05/02/27	102 410	0,01
200 000 EUR	Commerzbank AG, 1.875%, 28/02/28	189 884	0,02	200 000 EUR	Deutsche Post AG, 0.375%, 20/05/26	188 154	0,02
200 000 EUR	Commerzbank AG, 4.625%, 21/03/28	204 674	0,02	200 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.000%, 13/12/27	187 188	0,02
200 000 EUR	Commerzbank AG, 1.500%, 28/08/28	190 864	0,02	590 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.625%, 05/12/28	561 792	0,07
200 000 EUR	Commerzbank AG, 5.250%, 25/03/29	210 070	0,03	200 000 EUR	Deutsche Post AG, 0.750%, 20/05/29	182 764	0,02
500 000 EUR	Continental AG, 3.625%, 30/11/27	508 040	0,06	200 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.000%, 20/05/32	177 914	0,02
200 000 EUR	Continental AG, 4.000%, 01/06/28	206 386	0,02	400 000 EUR	Deutsche Post AG, 3.375%, 03/07/33	408 408	0,05
300 000 EUR	Covestro AG, 4.750%, 15/11/28	319 572	0,04	375 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 0.875%, 25/03/26	358 849	0,04
410 000 EUR	Covestro AG, 1.375%, 12/06/30	369 664	0,04	200 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 0.500%, 05/07/27	186 664	0,02
400 000 EUR	Deutsche Bank AG, 2.750%, 17/02/25	394 816	0,05	200 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 1.375%, 05/07/34	172 856	0,02
200 000 EUR	Deutsche Bank AG, 4.500%, 19/05/26	203 016	0,02	300 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 2.250%, 29/03/39	281 340	0,03
100 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.375%, 10/06/26	96 926	0,01	300 000 EUR	Deutsche Wohnen SE, 1.500%, 30/04/30	262 230	0,03
600 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.625%, 20/01/27	563 802	0,07	200 000 EUR	DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH, 2.500%, 25/01/27	172 062	0,02
700 000 EUR	Deutsche Bank AG, 4.000%, 29/11/27	686 460	0,08	125 000 EUR	EON SE, 0.125%, 18/01/26	117 790	0,01
700 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.750%, 17/01/28	648 977	0,08	550 000 EUR	EON SE, 0.250%, 24/10/26	513 700	0,06
900 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.875%, 23/02/28	845 901	0,10	500 000 EUR	EON SE, 3.500%, 12/01/28	511 640	0,06
600 000 EUR	Deutsche Bank AG, 3.250%, 24/05/28	587 202	0,07	350 000 EUR	EON SE, 0.750%, 20/02/28	324 233	0,04
700 000 EUR	Deutsche Bank AG, 5.375%, 11/01/29	732 620	0,09	500 000 EUR	EON SE, 0.100%, 19/12/28	446 480	0,05
1 000 000 EUR	Deutsche Bank AG, 5.000%, 05/09/30	1 032 880	0,12	215 000 EUR	EON SE, 3.750%, 01/03/29	222 469	0,03
900 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.750%, 19/11/30	782 127	0,09	990 000 EUR	EON SE, 1.625%, 22/05/29	932 372	0,11
400 000 EUR	Deutsche Bank AG, 5.625%, 19/05/31	404 684	0,05	300 000 EUR	EON SE, 0.750%, 18/12/30	262 371	0,03
				261 000 EUR	EON SE, 4.000%, 29/08/33	274 614	0,03
				215 000 EUR	EON SE, 0.875%, 18/10/34	173 026	0,02
				195 000 EUR	EON SE, 3.875%, 12/01/35	202 699	0,02

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
200 000 EUR	Eurogrid GmbH, 1.875%, 10/06/25	195 492	0,02	200 000 EUR	LEG Immobilien SE, 0.875%, 17/01/29	174 792	0,02
200 000 EUR	Eurogrid GmbH, 1.500%, 18/04/28	186 912	0,02	400 000 EUR	LEG Immobilien SE, 1.000%, 19/11/32	311 256	0,04
400 000 EUR	Eurogrid GmbH, 3.722%, 27/04/30	407 972	0,05	200 000 EUR	LEG Immobilien SE, 1.500%, 17/01/34	156 916	0,02
300 000 EUR	Eurogrid GmbH, 3.279%, 05/09/31	298 260	0,03	100 000 EUR	LEG Immobilien SE, 1.625%, 28/11/34	76 193	0,01
200 000 EUR	Evonik Industries AG, 2.250%, 25/09/27	193 410	0,02	400 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.375%, 11/05/28	377 472	0,05
350 000 EUR	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, 1.500%, 11/07/25	337 862	0,04	1 170 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.500%, 03/07/29	1 094 500	0,13
210 000 EUR	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, 1.250%, 29/11/29	182 784	0,02	220 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.375%, 22/05/30	212 230	0,03
500 000 EUR	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, 1.500%, 29/05/30	431 480	0,05	390 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.125%, 06/11/31	341 269	0,04
500 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 1.875%, 24/05/25	489 210	0,06	780 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.750%, 11/03/33	643 625	0,08
500 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 4.250%, 28/05/26	511 165	0,06	1 010 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.125%, 03/07/37	912 818	0,11
410 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 2.875%, 15/02/29	406 310	0,05	190 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.500%, 09/03/26	183 705	0,02
500 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 5.000%, 28/11/29	533 775	0,06	440 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.000%, 22/08/26	430 848	0,05
200 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 5.125%, 05/10/30	215 348	0,03	400 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.125%, 16/07/25	380 696	0,05
200 000 EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 4.875%, 17/03/25	200 518	0,02	700 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 1.875%, 15/06/26	682 059	0,08
200 000 EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.375%, 09/03/26	183 770	0,02	200 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 2.375%, 15/06/30	193 710	0,02
400 000 EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.500%, 22/09/26	368 444	0,04	200 000 EUR	Merck KGaA, 2.875%, 25/06/79	183 564	0,02
180 000 EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 4.875%, 30/03/27	181 960	0,02	200 000 EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.375%, 09/03/29	169 702	0,02
200 000 EUR	Hamburger Sparkasse AG, 4.375%, 12/02/29	209 336	0,03	200 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 1.250%, 26/05/41	165 770	0,02
400 000 EUR	Hannover Rueck SE, 1.125%, 18/04/28	381 652	0,05	500 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 1.250%, 26/05/41	414 425	0,05
600 000 EUR	Hannover Rueck SE, 1.125%, 09/10/39	510 054	0,06	400 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 3.625%, perpetual	408 516	0,05
200 000 EUR	Hannover Rueck SE, 3.375%, perpetual	196 454	0,02	400 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 3.625%, perpetual	410 492	0,05
500 000 EUR	Heidelberg Materials AG, 3.750%, 31/05/32	505 025	0,06	200 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 4.000%, perpetual	211 930	0,03
410 000 EUR	Hella GmbH & Co KGaA, 0.500%, 26/01/27	373 592	0,04	400 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 4.375%, perpetual	429 196	0,05
200 000 EUR	Henkel AG & Co KGaA, 2.625%, 13/09/27	198 862	0,02	400 000 EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.500%, 30/06/26	408 964	0,05
200 000 EUR	Heraeus Finance GmbH, 2.625%, 09/06/27	194 180	0,02	300 000 EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.375%, 13/09/27	309 186	0,04
700 000 EUR	Hochtief AG, 0.625%, 26/04/29	605 752	0,07	300 000 EUR	SAP SE, 1.000%, 13/03/26	289 071	0,03
500 000 EUR	Infineon Technologies AG, 1.625%, 24/06/29	463 345	0,06	400 000 EUR	SAP SE, 0.125%, 18/05/26	376 340	0,04
200 000 EUR	KION Group AG, 1.625%, 24/09/25	190 402	0,02	400 000 EUR	SAP SE, 1.375%, 13/03/30	370 276	0,04
500 000 EUR	Knorr-Bremse AG, 1.125%, 13/06/25	485 080	0,06	1 000 000 EUR	SAP SE, 1.625%, 10/03/31	932 870	0,11
300 000 EUR	Lanxess AG, 1.750%, 22/03/28	274 719	0,03				
400 000 EUR	Lanxess AG, 0.625%, 01/12/29	325 444	0,04				
200 000 EUR	LEG Immobilien SE, 0.375%, 17/01/26	187 220	0,02				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
200 000 EUR	Talanx AG, 2.500%, 23/07/26	196 368	0,02	200 000 EUR	Vonovia SE, 1.500%, 14/06/41	130 060	0,02
200 000 EUR	Talanx AG, 4.000%, 25/10/29	208 306	0,03	250 000 EUR	WPP Finance Deutschland GmbH, 1.625%, 23/03/30	227 780	0,03
300 000 EUR	Talanx AG, 2.250%, 05/12/47	279 780	0,03				
400 000 EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.000%, 26/09/27	411 192	0,05	Allemagne – Total			
200 000 EUR	Vier Gas Transport GmbH, 1.500%, 25/09/28	186 592	0,02	68 268 584 7,99			
500 000 EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.625%, 26/09/32	543 945	0,06	Guernesey			
155 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 1.250%, 15/12/25	148 929	0,02	300 000 EUR	Sirius Real Estate Ltd, 1.125%, 22/06/26	270 489	0,03
1 100 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 2.500%, 31/07/26	1 071 719	0,13	200 000 EUR	Sirius Real Estate Ltd, 1.750%, 24/11/28	165 314	0,02
500 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 4.625%, 03/05/31	524 310	0,06	Guernesey – Total			
500 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 4.250%, perpetual	505 945	0,06	435 803 0,05			
200 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 4.375%, perpetual	206 218	0,02	Hong Kong			
230 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.010%, 12/02/25	220 876	0,03	200 000 EUR	AIA Group Ltd, 0.880%, 09/09/33	170 590	0,02
200 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 3.000%, 06/04/25	198 776	0,02	Hong-Kong – Total			
290 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 2.250%, 16/10/26	283 185	0,03	170 590 0,02			
345 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.125%, 12/02/27	313 256	0,04	Hongrie			
200 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 2.250%, 01/10/27	194 738	0,02	300 000 EUR	MOL Hungarian Oil & Gas PLC, 1.500%, 08/10/27	271 443	0,03
275 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.875%, 31/01/28	248 828	0,03	200 000 EUR	OTP Bank Nyrt, 7.350%, 04/03/26	205 314	0,02
200 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.375%, 12/02/30	165 236	0,02	200 000 EUR	OTP Bank Nyrt, 6.125%, 05/10/27	206 814	0,03
300 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.625%, 15/08/25	291 357	0,03	Hongrie – Total			
165 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.250%, 12/01/26	154 711	0,02	683 571 0,08			
290 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 4.500%, 25/03/26	296 345	0,04	Islande			
190 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.500%, 19/06/26	181 786	0,02	300 000 EUR	Arion Banki HF, 7.250%, 25/05/26	315 924	0,04
300 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.375%, 20/07/26	278 169	0,03	Islande – Total			
200 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.500%, 12/01/29	173 456	0,02	315 924 0,04			
180 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 4.625%, 25/03/29	189 839	0,02	Irlande			
250 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 4.750%, 25/09/31	266 660	0,03	270 000 EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 1.500%, 27/09/26	260 564	0,03
300 000 EUR	Vonovia SE, 0.010%, 01/12/25	279 717	0,03	490 000 EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 0.375%, 19/11/27	448 791	0,05
400 000 EUR	Vonovia SE, 4.750%, 23/05/27	414 796	0,05	150 000 EUR	AIB Group PLC, 2.250%, 03/07/25	147 396	0,02
600 000 EUR	Vonovia SE, 0.375%, 16/06/27	536 400	0,06	500 000 EUR	AIB Group PLC, 3.625%, 04/07/26	500 020	0,06
300 000 EUR	Vonovia SE, 1.875%, 28/06/28	277 164	0,03	500 000 EUR	AIB Group PLC, 2.250%, 04/04/28	479 495	0,06
300 000 EUR	Vonovia SE, 0.625%, 14/12/29	247 449	0,03	200 000 EUR	AIB Group PLC, 5.750%, 16/02/29	214 968	0,02
400 000 EUR	Vonovia SE, 5.000%, 23/11/30	422 820	0,05	300 000 EUR	AIB Group PLC, 4.625%, 23/07/29	309 561	0,04
400 000 EUR	Vonovia SE, 1.000%, 16/06/33	303 756	0,04	200 000 EUR	AIB Group PLC, 5.250%, 23/10/31	216 040	0,03
				300 000 EUR	Atlas Copco Finance DAC, 0.750%, 08/02/32	251 910	0,03
				300 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 1.875%, 05/06/26	291 765	0,03
				600 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 0.375%, 10/05/27	557 766	0,06
				100 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 4.875%, 16/07/28	104 551	0,01
				200 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 1.375%, 11/08/31	186 504	0,02
				200 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 6.750%, 01/03/33	216 116	0,03
				200 000 EUR	CAAuto Bank SPA/Ireland, 4.750%, 25/01/27	206 638	0,02
				200 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.010%, 06/09/25	189 156	0,02
				180 000 EUR	Cloverie PLC for Zurich Insurance Co Ltd, 1.500%, 15/12/28	168 964	0,02
				155 000 EUR	CRH Finance DAC, 1.375%, 18/10/28	143 369	0,02

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Irlande (suite)				Irlande (suite)			
80 000 EUR	CRH SMW Finance DAC, 1.250%, 05/11/26	76 224	0,01	300 000 EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.000%, 22/09/33	239 517	0,03
400 000 EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.000%, 11/07/27	411 040	0,05	525 000 EUR	Transmission Finance DAC, 0.375%, 18/06/28	458 399	0,05
300 000 EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.000%, 11/07/31	311 568	0,04	300 000 EUR	Vodafone International Financing DAC, 3.750%, 02/12/34	309 465	0,04
300 000 EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.250%, 11/07/35	315 255	0,04	200 000 EUR	Vodafone International Financing DAC, 4.000%, 10/02/43	202 608	0,02
500 000 EUR	Dell Bank International DAC, 4.500%, 18/10/27	520 875	0,06	600 000 EUR	Vodafone International Financing DAC, 3.250%, perpetual	607 512	0,07
500 000 EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.450%, 15/09/27	443 840	0,05	200 000 EUR	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 1.625%, 17/06/39	161 640	0,02
200 000 EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.950%, 15/09/31	160 128	0,02	190 000 EUR	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 1.875%, 17/09/50	165 370	0,02
210 000 EUR	Eaton Capital UnLtd Co, 0.697%, 14/05/25	202 310	0,02	Irlande – Total		16 005 058	1,87
300 000 EUR	Eaton Capital UnLtd Co, 0.128%, 08/03/26	281 547	0,03	Italie			
100 000 EUR	Eaton Capital UnLtd Co, 0.577%, 08/03/30	86 341	0,01	390 000 EUR	2i Rete Gas SpA, 2.195%, 11/09/25	382 231	0,05
270 000 EUR	Experian Europe DAC, 1.560%, 16/05/31	243 089	0,03	350 000 EUR	2i Rete Gas SpA, 1.750%, 28/08/26	336 252	0,04
200 000 EUR	Fresenius Finance Ireland PLC, zero coupon, 01/10/25	188 332	0,02	200 000 EUR	2i Rete Gas SpA, 1.608%, 31/10/27	187 976	0,02
200 000 EUR	Fresenius Finance Ireland PLC, 0.875%, 01/10/31	161 690	0,02	350 000 EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.625%, 08/06/27	335 723	0,04
350 000 EUR	Fresenius Finance Ireland PLC, 3.000%, 30/01/32	331 520	0,04	200 000 EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.750%, 30/07/31	172 486	0,02
200 000 EUR	Grenke Finance PLC, 7.875%, 06/04/27	215 774	0,02	200 000 EUR	Aeroporti di Roma SpA, 4.875%, 10/07/33	210 492	0,03
50 000 EUR	Johnson Controls International PLC, 1.375%, 25/02/25	48 628	0,01	200 000 EUR	Anima Holding SpA, 1.500%, 22/04/28	179 994	0,02
300 000 EUR	Johnson Controls International PLC, 4.250%, 23/05/35	317 997	0,04	300 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 4.125%, 04/05/26	301 998	0,04
200 000 EUR	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 0.375%, 15/09/27	180 532	0,02	180 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 3.875%, 29/01/29	181 930	0,02
300 000 EUR	Kerry Group Financial Services Unltd Co, 0.625%, 20/09/29	264 414	0,03	100 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 1.713%, 30/06/32	80 532	0,01
535 000 EUR	Kerry Group Financial Services Unltd Co, 0.875%, 01/12/31	453 578	0,05	500 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.800%, 06/07/32	539 280	0,06
500 000 EUR	Linde PLC, 3.625%, 12/06/25	503 040	0,06	200 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.399%, 20/04/33	212 268	0,03
200 000 EUR	Linde PLC, 1.000%, 31/03/27	189 044	0,02	200 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.272%, 12/09/33	210 836	0,03
600 000 EUR	Linde PLC, 3.375%, 12/06/29	616 422	0,08	400 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.500%, 27/10/47	415 568	0,05
200 000 EUR	Linde PLC, 1.375%, 31/03/31	180 310	0,02	300 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.000%, 08/06/48	309 087	0,04
400 000 EUR	Linde PLC, 3.625%, 12/06/34	418 788	0,05	300 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 4.596%, 30/11/49	298 611	0,04
300 000 EUR	Linde PLC, 1.625%, 31/03/35	257 568	0,03	410 000 EUR	ASTM SpA, 1.625%, 08/02/28	384 559	0,05
200 000 EUR	Linde PLC, 1.000%, 30/09/51	121 198	0,01	300 000 EUR	ASTM SpA, 1.500%, 25/01/30	260 841	0,03
250 000 EUR	PartnerRe Ireland Finance DAC, 1.250%, 15/09/26	236 135	0,03	400 000 EUR	ASTM SpA, 2.375%, 25/11/33	335 616	0,04
410 000 EUR	Ryanair DAC, 2.875%, 15/09/25	406 035	0,05	200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 4.375%, 16/09/25	202 244	0,02
400 000 EUR	Ryanair DAC, 0.875%, 25/05/26	377 616	0,04	200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.875%, 04/11/25	193 642	0,02
186 000 EUR	Securitas Treasury Ireland DAC, 4.250%, perpetual	189 551	0,02	200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.750%, 26/06/26	190 496	0,02
300 000 EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 0.500%, 22/09/29	256 584	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Italie (suite)				Italie (suite)			
200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.750%, 01/02/27	189 328	0,02	400 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 2.125%, 26/05/25	392 012	0,05
200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.625%, 25/01/28	183 688	0,02	200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.500%, 02/10/25	203 738	0,02
200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.875%, 26/09/29	177 850	0,02	500 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.625%, 24/02/26	470 020	0,06
200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 2.000%, 15/01/30	177 186	0,02	339 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.375%, 29/08/27	347 909	0,04
200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 2.250%, 25/01/32	171 744	0,02	1 000 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.750%, 06/09/27	1 036 600	0,12
150 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 5.125%, 14/06/33	156 864	0,02	400 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.750%, 16/03/28	360 312	0,04
600 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 4.750%, perpetual	618 180	0,07	400 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.750%, 04/07/29	364 404	0,04
600 000 EUR	Banco BPM SpA, 4.625%, 29/11/27	618 492	0,07	730 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.250%, 13/01/30	783 107	0,09
500 000 EUR	CAAUTO Bank SPA/Ireland, 4.375%, 08/06/26	507 885	0,06	400 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.125%, 29/08/31	426 856	0,05
100 000 EUR	Cassa Centrale Banca - Credito Cooperativo Italiano SpA, 5.885%, 16/02/27	103 551	0,01	300 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.000%, perpetual	304 392	0,04
80 000 EUR	Covivio SA, 2.375%, 20/02/28	76 554	0,01	400 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.875%, perpetual	420 716	0,05
180 000 EUR	Credito Emiliano SpA, 4.875%, 26/03/30	185 744	0,02	450 000 EUR	Iren SpA, 1.950%, 19/09/25	439 780	0,05
720 000 EUR	Enel SpA, 5.625%, 21/06/27	776 203	0,09	200 000 EUR	Iren SpA, 1.500%, 24/10/27	188 828	0,02
1 000 000 EUR	Enel SpA, 6.375%, 31/12/99	1 044 580	0,12	210 000 EUR	Italgas SpA, 1.625%, 19/01/27	200 855	0,02
300 000 EUR	Enel SpA, 6.625%, 31/12/99	318 942	0,04	300 000 EUR	Italgas SpA, 0.010%, 16/02/28	265 347	0,03
690 000 EUR	Enel SpA, 3.500%, perpetual	677 525	0,08	480 000 EUR	Italgas SpA, 1.625%, 18/01/29	449 232	0,05
550 000 EUR	Enel SpA, 3.375%, perpetual	523 699	0,06	410 000 EUR	Italgas SpA, 0.875%, 24/04/30	352 764	0,04
820 000 EUR	Enel SpA, 1.375%, perpetual	715 967	0,08	150 000 EUR	Italgas SpA, 1.000%, 11/12/31	124 640	0,02
100 000 EUR	Enel SpA, 1.375%, perpetual	87 313	0,01	200 000 EUR	Italgas SpA, 4.125%, 08/06/32	206 812	0,02
300 000 EUR	Enel SpA, 1.875%, perpetual	237 483	0,03	500 000 EUR	Leasys SpA, 4.500%, 26/07/26	508 905	0,06
190 000 EUR	Enel SpA, 2.250%, perpetual	173 915	0,02	585 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.125%, 23/04/25	563 458	0,06
500 000 EUR	Enel SpA, 2.250%, perpetual	457 670	0,05	690 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.875%, 15/01/26	656 466	0,08
370 000 EUR	Eni SpA, 3.750%, 12/09/25	372 312	0,04	200 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.750%, 15/07/27	182 140	0,02
860 000 EUR	Eni SpA, 1.500%, 02/02/26	827 621	0,10	180 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 4.875%, 13/09/27	185 053	0,02
330 000 EUR	Eni SpA, 1.250%, 18/05/26	316 321	0,04	300 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.750%, 02/11/28	269 142	0,03
390 000 EUR	Eni SpA, 1.500%, 17/01/27	372 536	0,04	200 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 4.375%, 01/02/30	205 988	0,02
320 000 EUR	Eni SpA, 1.625%, 17/05/28	301 408	0,04	350 000 EUR	Snam SpA, 1.250%, 28/08/25	338 618	0,04
200 000 EUR	Eni SpA, 0.375%, 14/06/28	178 050	0,02	161 000 EUR	Snam SpA, 1.375%, 25/10/27	151 759	0,02
490 000 EUR	Eni SpA, 1.125%, 19/09/28	450 795	0,05	390 000 EUR	Snam SpA, 0.010%, 07/12/28	334 464	0,04
330 000 EUR	Eni SpA, 3.625%, 29/01/29	338 956	0,04	225 000 EUR	Snam SpA, 0.750%, 20/06/29	196 310	0,02
690 000 EUR	Eni SpA, 0.625%, 23/01/30	594 118	0,07	100 000 EUR	Snam SpA, 4.000%, 27/11/29	102 990	0,01
670 000 EUR	Eni SpA, 2.000%, 18/05/31	614 531	0,07	200 000 EUR	Snam SpA, 0.750%, 17/06/30	169 802	0,02
400 000 EUR	Eni SpA, 4.250%, perpetual	419 788	0,05	200 000 EUR	Snam SpA, 0.625%, 30/06/31	164 082	0,02
300 000 EUR	Eni SpA, 2.000%, perpetual	273 537	0,03				
500 000 EUR	Eni SpA, 2.625%, perpetual	479 810	0,06				
500 000 EUR	Eni SpA, 2.750%, perpetual	429 685	0,05				
500 000 EUR	Eni SpA, 3.375%, perpetual	458 340	0,05				
190 000 EUR	ERG SpA, 1.875%, 11/04/25	186 251	0,02				
150 000 EUR	ERG SpA, 0.875%, 15/09/31	120 447	0,01				
200 000 EUR	FinecoBank Banca Fineco SpA, 4.625%, 23/02/29	203 922	0,02				
250 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.625%, 21/04/25	243 932	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Italie (suite)				Japon (suite)			
500 000 EUR	Snam SpA, 1.250%, 20/06/34	404 545	0,05	200 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 1.631%, 08/04/27	189 366	0,02
415 000 EUR	Snam SpA, 1.000%, 12/09/34	321 181	0,04	400 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 3.490%, 05/09/27	401 424	0,05
105 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.125%, 25/07/25	99 609	0,01	500 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.157%, 20/05/28	513 075	0,06
300 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.000%, 11/10/28	273 441	0,03	410 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.402%, 06/09/29	345 105	0,04
200 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.375%, 23/06/29	172 680	0,02	400 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.470%, 06/09/29	345 460	0,04
150 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.375%, 25/09/30	124 130	0,02	190 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.797%, 15/04/30	161 164	0,02
500 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.875%, 24/07/33	515 520	0,06	400 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.608%, 28/08/30	423 752	0,05
530 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.625%, perpetual	540 939	0,06	400 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.693%, 07/10/30	333 104	0,04
295 000 EUR	Unicredit SpA, 1.625%, 18/01/32	252 190	0,03	200 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 2.096%, 08/04/32	179 352	0,02
700 000 EUR	UniCredit SpA, 0.325%, 19/01/26	659 127	0,08	200 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.029%, 05/09/32	206 100	0,02
470 000 EUR	UniCredit SpA, 1.200%, 20/01/26	456 191	0,05	500 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.416%, 20/05/33	525 990	0,06
890 000 EUR	UniCredit SpA, 1.250%, 16/06/26	859 055	0,10	200 000 EUR	Nissan Motor Co Ltd, 2.652%, 17/03/26	195 218	0,02
730 000 EUR	UniCredit SpA, 2.200%, 22/07/27	705 202	0,08	400 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.010%, 03/03/25	383 920	0,05
444 000 EUR	UniCredit SpA, 5.850%, 15/11/27	470 387	0,06	200 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.082%, 13/12/25	188 404	0,02
300 000 EUR	UniCredit SpA, 4.800%, 17/01/29	313 986	0,04	340 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.399%, 13/12/28	302 008	0,04
300 000 EUR	UniCredit SpA, 4.450%, 16/02/29	306 912	0,04	300 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.342%, 03/03/30	258 105	0,03
100 000 EUR	UniCredit SpA, 0.800%, 05/07/29	88 912	0,01	100 000 EUR	ORIX Corp, 1.919%, 20/04/26	97 022	0,01
200 000 EUR	UniCredit SpA, 4.600%, 14/02/30	208 750	0,03	500 000 EUR	ORIX Corp, 4.477%, 01/06/28	525 160	0,06
300 000 EUR	UniCredit SpA, 0.850%, 19/01/31	247 338	0,03	440 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1.546%, 15/06/26	421 876	0,05
		39 672 981	4,64	170 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1.413%, 14/06/27	159 613	0,02
Japon				140 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0.303%, 28/10/27	125 744	0,01
490 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 0.336%, 19/04/27	446 380	0,05	100 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0.632%, 23/10/29	85 559	0,01
575 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 0.541%, 23/10/28	507 598	0,06	700 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 4.492%, 12/06/30	738 073	0,09
200 000 EUR	East Japan Railway Co, 2.614%, 08/09/25	197 702	0,02	410 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 2.250%, 21/11/26	400 578	0,05
200 000 EUR	East Japan Railway Co, 3.245%, 08/09/30	202 386	0,02	490 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 0.750%, 09/07/27	453 814	0,05
300 000 EUR	East Japan Railway Co, 3.976%, 05/09/32	319 332	0,04	190 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 1.000%, 09/07/29	169 300	0,02
300 000 EUR	East Japan Railway Co, 0.773%, 15/09/34	235 812	0,03	410 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 3.000%, 21/11/30	404 387	0,05
200 000 EUR	East Japan Railway Co, 1.104%, 15/09/39	144 198	0,02	300 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 1.375%, 09/07/32	256 686	0,03
300 000 EUR	East Japan Railway Co, 4.389%, 05/09/43	325 974	0,04	500 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 2.000%, 09/07/40	396 690	0,05
200 000 EUR	East Japan Railway Co, 4.110%, perpetual	211 260	0,02				
400 000 EUR	Mitsubishi ufj Financial Group Inc, 3.556%, perpetual	409 080	0,05	Japon – Total		13 255 410	1,55
400 000 EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0.337%, 08/06/27	371 776	0,04				
335 000 EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0.848%, 19/07/29	300 177	0,04				
200 000 EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4.636%, 07/06/31	211 158	0,02				
200 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.184%, 13/04/26	186 528	0,02				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Jersey				Luxembourg (suite)			
480 000 EUR	Aptiv PLC, 1.500%, 10/03/25	467 419	0,05	380 000 EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.125%, 17/10/28	342 654	0,04
210 000 EUR	Aptiv PLC, 1.600%, 15/09/28	195 752	0,02	380 000 EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.500%, 17/10/31	319 702	0,04
350 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 1.500%, 12/10/25	339 027	0,04	190 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.750%, 12/09/25	184 900	0,02
250 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 1.875%, 12/07/32	218 705	0,03	240 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.875%, 19/01/26	233 126	0,03
300 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 4.500%, 11/07/33	319 203	0,04	520 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.750%, 25/03/27	497 905	0,06
210 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 1.875%, 14/03/34	176 929	0,02	210 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.625%, 03/07/29	191 108	0,02
Jersey – Total		1 717 035	0,20	300 000 EUR	CPI Property Group SA, 1.625%, 23/04/27	219 765	0,03
Liechtenstein				300 000 EUR	CPI Property Group SA, 1.500%, 27/01/31	156 219	0,02
200 000 EUR	Swiss Life Finance I Ltd, 3.250%, 31/08/29	200 422	0,02	350 000 EUR	Czech Gas Networks Investments Sarl, 1.000%, 16/07/27	321 759	0,04
300 000 EUR	Swiss Life Finance I Ltd, 0.500%, 15/09/31	243 276	0,03	500 000 EUR	Czech Gas Networks Investments Sarl, 0.875%, 31/03/31	400 845	0,05
Liechtenstein – Total		443 698	0,05	400 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.200%, 18/03/26	375 500	0,04
Luxembourg				300 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.450%, 18/03/28	271 008	0,03
200 000 EUR	Acef Holding SCA, 0.750%, 14/06/28	172 036	0,02	500 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.750%, 18/09/31	421 425	0,05
300 000 EUR	ArcelorMittal SA, 1.750%, 19/11/25	288 888	0,03	940 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.350%, 18/09/39	710 020	0,09
300 000 EUR	ArcelorMittal SA, 4.875%, 26/09/26	309 717	0,04	300 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.800%, 18/09/49	217 989	0,03
300 000 EUR	Aroundtown SA, 0.010%, 16/07/26	251 835	0,03	390 000 EUR	DH Europe Finance Sarl, 1.200%, Sarl, 0.875%, 31/03/31	368 207	0,04
400 000 EUR	Aroundtown SA, 0.375%, 15/04/27	321 500	0,04	200 000 EUR	Euroclear Investments SA, 1.500%, 11/04/30	183 248	0,02
400 000 EUR	Aroundtown SA, 1.625%, perpetual	129 088	0,02	100 000 EUR	Euroclear Investments SA, 2.625%, 11/04/48	92 664	0,01
300 000 EUR	Aroundtown SA, 2.875%, perpetual	105 171	0,01	300 000 EUR	Eurofins Scientific SE, 4.000%, 06/07/29	303 927	0,04
200 000 EUR	AXA Logistics Europe Master SCA, 0.375%, 15/11/26	181 728	0,02	300 000 EUR	Eurofins Scientific SE, 4.750%, 06/09/30	315 957	0,04
200 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.208%, 04/06/26	190 918	0,02	300 000 EUR	GELF Bond Issuer I SA, 1.625%, 20/10/26	285 189	0,03
800 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 3.553%, 13/09/29	816 648	0,10	370 000 EUR	GELF Bond Issuer I SA, 1.125%, 18/07/29	313 856	0,04
235 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.213%, 12/02/36	181 812	0,02	300 000 EUR	Grand City Properties SA, 1.375%, 03/08/26	276 456	0,03
320 000 EUR	Bevco Lux Sarl, 1.500%, 16/09/27	300 387	0,04	200 000 EUR	Grand City Properties SA, 1.500%, perpetual	90 040	0,01
225 000 EUR	Bevco Lux Sarl, 1.000%, 16/01/30	188 003	0,02	420 000 EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.625%, 07/04/26	408 026	0,05
490 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2.200%, 24/07/25	469 038	0,06	410 000 EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.500%, 14/06/27	393 416	0,05
190 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1.250%, 26/04/27	166 890	0,02	550 000 EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.750%, 24/04/28	524 562	0,06
180 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1.250%, 12/03/29	151 690	0,02				
100 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 3.625%, 29/10/29	91 964	0,01				
300 000 EUR	CBRE Global Investors Open-Ended Funds SCA SICAV-SIF-Pan European Core Fund, 0.500%, 27/01/28	265 056	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Luxembourg (suite)				Luxembourg (suite)			
100 000 EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 4.875%, 21/11/33	106 536	0,01	210 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.010%, 03/12/25	199 330	0,02
200 000 EUR	Highland Holdings Sarl, 0.318%, 15/12/26	184 526	0,02	500 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 1.125%, 01/04/26	482 925	0,06
200 000 EUR	Highland Holdings Sarl, 0.934%, 15/12/31	165 306	0,02	700 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.010%, 14/06/26	656 649	0,08
100 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 1.500%, 06/04/25	97 405	0,01	200 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.875%, 29/03/27	189 496	0,02
350 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.500%, 29/11/26	326 207	0,04	358 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.500%, 13/12/27	369 725	0,04
290 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.250%, 26/05/28	281 097	0,03	200 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.000%, 15/03/28	204 044	0,02
690 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 1.750%, 29/08/29	636 304	0,07	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.500%, 17/01/30	104 180	0,01
400 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.625%, 06/04/30	339 368	0,04	390 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 1.500%, 01/04/30	362 528	0,04
280 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.500%, 23/04/31	227 973	0,03	200 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.250%, 15/01/31	205 822	0,02
200 000 EUR	John Deere Bank SA, 2.500%, 14/09/26	197 788	0,02	200 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 1.250%, 29/03/31	179 882	0,02
690 000 EUR	John Deere Cash Management SARL, 2.200%, 02/04/32	651 367	0,08	800 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.750%, 13/03/33	858 648	0,10
690 000 EUR	John Deere Cash Management SARL, 1.850%, perpetual	666 574	0,08	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.375%, 15/11/34	103 446	0,01
300 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.250%, 02/07/25	286 254	0,03	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.750%, 14/11/35	106 759	0,01
600 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.625%, 15/10/25	592 230	0,07	210 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.375%, 03/12/40	139 686	0,02
300 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.125%, 07/03/27	283 575	0,03	735 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.875%, 14/06/41	528 685	0,06
245 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.375%, 15/10/28	217 937	0,03	1 350 000 EUR	Novartis Finance SA, 1.625%, 09/11/26	1 317 573	0,15
300 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.000%, 15/10/28	300 795	0,04	490 000 EUR	Novartis Finance SA, 0.010%, 23/09/28	433 513	0,05
230 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.625%, 07/03/31	208 316	0,02	200 000 EUR	Novartis Finance SA, 1.700%, 14/08/38	172 010	0,02
300 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.000%, 02/07/31	259 326	0,03	250 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 1.876%, 17/04/25	244 563	0,03
333 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.125%, 15/10/31	334 149	0,04	55 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 1.750%, 15/03/28	51 729	0,01
795 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.750%, 15/10/32	654 969	0,08	50 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 2.375%, 14/11/30	46 003	0,01
282 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.375%, 15/10/34	284 532	0,03	390 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 1.625%, 17/06/32	326 567	0,04
200 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.375%, 15/10/34	201 796	0,02	640 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 0.750%, 23/03/33	488 051	0,06
400 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.500%, 02/07/39	305 024	0,04	800 000 EUR	Repsol Europe Finance Sarl, 0.375%, 06/07/29	692 072	0,08
500 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.375%, 15/10/40	366 575	0,04	200 000 EUR	Repsol Europe Finance Sarl, 0.875%, 06/07/33	160 772	0,02
100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.750%, 02/07/49	70 249	0,01	670 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.000%, 26/03/26	642 342	0,08
540 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.625%, 15/10/50	367 540	0,04	300 000 EUR	Richemont International Holding SA, 0.750%, 26/05/28	275 319	0,03
200 000 EUR	Mohawk Capital Finance SA, 1.750%, 12/06/27	189 084	0,02	570 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.500%, 26/03/30	527 193	0,06
				550 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.625%, 26/05/40	439 148	0,05

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Luxembourg (suite)				Pays-Bas (suite)			
200 000 EUR	Segro Capital Sarl, 1.250%, 23/03/26	191 244	0,02	400 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.625%, 10/01/26	403 200	0,05
200 000 EUR	Segro Capital Sarl, 1.875%, 23/03/30	183 560	0,02	300 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.500%, 15/04/26	283 914	0,03
145 000 EUR	SELP Finance Sarl, 1.500%, 20/11/25	139 493	0,02	700 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.875%, 21/12/26	714 259	0,08
410 000 EUR	SELP Finance Sarl, 1.500%, 20/12/26	383 555	0,04	200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 2.375%, 01/06/27	194 668	0,02
200 000 EUR	SELP Finance Sarl, 3.750%, 10/08/27	200 032	0,02	400 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.000%, 16/01/28	410 192	0,05
410 000 EUR	SES SA, 1.625%, 22/03/26	390 603	0,05	500 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.375%, 20/10/28	518 460	0,06
210 000 EUR	SES SA, 0.875%, 04/11/27	190 061	0,02	300 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.500%, 23/09/29	254 913	0,03
300 000 EUR	Simon International Finance SCA, 1.250%, 13/05/25	289 503	0,03	200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.250%, 21/02/30	207 620	0,02
200 000 EUR	SIX Finance Luxembourg SA, 0.010%, 02/12/25	187 944	0,02	500 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.000%, 01/06/32	487 820	0,06
500 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.125%, 22/11/25	503 810	0,06	300 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 5.125%, 22/02/33	308 598	0,04
100 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.500%, 23/11/26	102 159	0,01	700 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 5.500%, 21/09/33	732 417	0,09
600 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 1.250%, 24/03/33	481 158	0,06	200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.500%, 21/11/34	214 616	0,03
400 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.000%, perpetual	401 832	0,05	400 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 1.250%, 28/05/25	387 768	0,04
100 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.250%, perpetual	102 826	0,01	1 000 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 1.250%, 20/01/34	809 430	0,10
210 000 EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.010%, 14/02/25	202 026	0,02	300 000 EUR	Achmea BV, 3.625%, 29/11/25	301 278	0,04
420 000 EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.010%, 16/02/29	362 947	0,04	200 000 EUR	Achmea BV, 1.500%, 26/05/27	189 798	0,02
200 000 EUR	Whirlpool EMEA Finance Sarl, 0.500%, 20/02/28	177 200	0,02	200 000 EUR	Achmea BV, 6.750%, 26/12/43	217 058	0,03
200 000 EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.250%, 02/11/26	189 002	0,02	300 000 EUR	Achmea BV, 4.250%, perpetual	297 117	0,04
300 000 EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.100%, 09/11/27	276 639	0,03	200 000 EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.125%, 21/09/28	177 206	0,02
				200 000 EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.500%, 21/09/31	166 130	0,02
Luxembourg – Total		37 268 898	4,36	195 000 EUR	Akelius Residential Property Financing BV, 1.000%, 17/01/28	167 796	0,02
Malte				200 000 EUR	Akelius Residential Property Financing BV, 0.750%, 22/02/30	155 116	0,02
200 000 EUR	Bank Of Valletta PLC, 10.000%, perpetual	217 496	0,03	590 000 EUR	Akzo Nobel NV, 1.625%, 14/04/30	533 124	0,06
Malte – Total		217 496	0,03	700 000 EUR	Akzo Nobel NV, 4.000%, perpetual	725 431	0,09
Mexique				200 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.010%, 22/11/26	185 580	0,02
200 000 EUR	America Movil SAB de CV, 0.750%, 26/06/27	184 388	0,02	600 000 EUR	Allianz Finance II BV, 3.000%, 13/03/28	609 726	0,07
100 000 EUR	America Movil SAB de CV, 2.125%, 10/03/28	95 717	0,01	300 000 EUR	Allianz Finance II BV, 1.500%, 15/01/30	280 131	0,03
Mexique – Total		280 105	0,03	300 000 EUR	Allianz Finance II BV, 1.375%, 21/04/31	274 923	0,03
Pays-Bas				100 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.500%, 22/11/33	80 377	0,01
300 000 EUR	ABB Finance BV, 3.250%, 16/01/27	303 477	0,04	300 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 0.750%, 08/03/25	290 019	0,03
300 000 EUR	ABB Finance BV, 0.010%, 1.750%, 12/06/27	252 627	0,03	200 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.375%, 08/03/28	187 184	0,02
300 000 EUR	ABB Finance BV, 3.375%, 19/01/30	307 662	0,04				
800 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.750%, 20/04/25	803 000	0,09				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
300 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.625%, 08/03/31	271 095	0,03	200 000 EUR	BMW Finance NV, 3.875%, 04/10/28	209 124	0,02
500 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.875%, 08/03/34	434 960	0,05	500 000 EUR	BMW Finance NV, 1.500%, 06/02/29	467 590	0,06
100 000 EUR	Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 1.125%, 17/09/25	96 453	0,01	200 000 EUR	BMW Finance NV, 4.125%, 04/10/33	215 386	0,03
300 000 EUR	Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 2.000%, 17/09/30	283 242	0,03	200 000 EUR	BMW Finance NV, 3.250%, perpetual	201 734	0,02
200 000 EUR	Argentum Netherlands BV for Swiss Life AG, 4.375%, perpetual	198 108	0,02	200 000 EUR	BMW Finance NV, 3.250%, perpetual	204 462	0,02
200 000 EUR	Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co Ltd, 3.500%, 01/10/46	196 910	0,02	200 000 EUR	BMW Finance NV, 3.625%, perpetual	207 994	0,02
200 000 EUR	Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co Ltd, 2.750%, 19/02/49	187 380	0,02	300 000 EUR	BNI Finance BV, 3.875%, 01/12/30	311 106	0,04
500 000 EUR	ASML Holding NV, 3.500%, 06/12/25	503 980	0,06	190 000 EUR	BP Capital Markets BV, 0.933%, 04/12/40	125 708	0,02
360 000 EUR	ASML Holding NV, 1.375%, 07/07/26	347 062	0,04	305 000 EUR	BP Capital Markets BV, 1.467%, 21/09/41	215 809	0,03
250 000 EUR	ASML Holding NV, 1.625%, 28/05/27	240 185	0,03	200 000 EUR	BP Capital Markets BV, 3.773%, perpetual	206 784	0,02
240 000 EUR	ASML Holding NV, 0.250%, 25/02/30	206 078	0,02	200 000 EUR	BP Capital Markets BV, 4.323%, perpetual	212 090	0,03
200 000 EUR	ASML Holding NV, 2.250%, 17/05/32	193 398	0,02	200 000 EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 2.750%, 23/09/25	198 148	0,02
300 000 EUR	ASR Nederland NV, 3.625%, 12/12/28	304 416	0,04	200 000 EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.000%, 14/05/27	187 394	0,02
600 000 EUR	ASR Nederland NV, 7.000%, 07/12/43	676 200	0,08	200 000 EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 0.625%, 21/11/29	173 054	0,02
100 000 EUR	ASR Nederland NV, 3.375%, 02/05/49	92 739	0,01	400 000 EUR	Coloplast Finance BV, 2.250%, 19/05/27	388 180	0,05
200 000 EUR	Athora Netherlands NV, 5.375%, 31/08/32	191 730	0,02	200 000 EUR	Coloplast Finance BV, 2.750%, 19/05/30	193 438	0,02
200 000 EUR	BASF Finance Europe NV, 0.750%, 10/11/26	190 224	0,02	280 000 EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 1.500%, 05/09/28	264 191	0,03
300 000 EUR	BAT Netherlands Finance BV, 3.125%, 07/04/28	299 295	0,04	200 000 EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 3.000%, 08/03/30	199 066	0,02
200 000 EUR	BAT Netherlands Finance BV, 5.375%, 16/02/31	210 266	0,02	1 560 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.125%, 14/07/25	1 577 940	0,19
250 000 EUR	BMW Finance NV, 1.000%, 21/01/25	243 415	0,03	560 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.250%, 23/03/26	539 851	0,06
455 000 EUR	BMW Finance NV, 3.500%, 06/04/25	455 874	0,05	300 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.250%, 30/10/26	279 549	0,03
550 000 EUR	BMW Finance NV, 1.000%, 29/08/25	531 624	0,06	570 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.375%, 03/02/27	541 956	0,06
100 000 EUR	BMW Finance NV, 1.000%, 29/08/25	96 659	0,01	400 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.375%, 01/12/27	366 912	0,04
400 000 EUR	BMW Finance NV, 0.010%, 11/01/26	377 596	0,04	900 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.000%, 10/01/30	929 295	0,11
550 000 EUR	BMW Finance NV, 1.125%, 22/05/26	527 257	0,06	300 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.625%, 25/02/33	239 013	0,03
240 000 EUR	BMW Finance NV, 0.750%, 13/07/26	227 426	0,03	900 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.233%, perpetual	926 190	0,11
300 000 EUR	BMW Finance NV, 0.375%, 24/09/27	276 561	0,03	190 000 EUR	CRH Funding BV, 1.625%, 05/05/30	173 103	0,02
315 000 EUR	BMW Finance NV, 1.000%, 22/05/28	292 147	0,03	200 000 EUR	CTP NV, 0.875%, 20/01/26	185 444	0,02
				450 000 EUR	CTP NV, 0.750%, 18/02/27	400 671	0,05
				500 000 EUR	CTP NV, 1.250%, 21/06/29	412 930	0,05

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
100 000 EUR	CTP NV, 1.500%, 27/09/31	77 795	0,01	700 000 EUR	EDP Finance BV, 2.000%, 22/04/25	687 162	0,08
200 000 EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.250%, 06/04/25	194 454	0,02	1 000 000 EUR	EDP Finance BV, 3.875%, 11/03/30	1 034 470	0,12
500 000 EUR	Daimler Truck International Finance BV, 3.875%, 19/06/26	508 430	0,06	232 000 EUR	ELM BV for Firmenich International SA, 3.750%, perpetual	227 038	0,03
400 000 EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.625%, 06/04/27	382 760	0,05	350 000 EUR	ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, 3.375%, 29/09/47	333 914	0,04
400 000 EUR	Daimler Truck International Finance BV, 3.875%, 19/06/29	413 076	0,05	490 000 EUR	ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group, 4.500%, perpetual	485 227	0,06
300 000 EUR	Danfoss Finance I BV, 0.125%, 28/04/26	278 667	0,03	200 000 EUR	ELM BV for Swiss Reinsurance Co Ltd, 2.600%, perpetual	193 162	0,02
200 000 EUR	Danfoss Finance II BV, 4.125%, 02/12/29	208 012	0,02	300 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.010%, 28/05/26	278 298	0,03
230 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.375%, 01/12/25	223 705	0,03	500 000 EUR	Enel Finance International NV, 3.875%, 09/03/29	516 505	0,06
470 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.375%, 30/01/27	451 881	0,05	400 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.500%, 17/06/30	334 988	0,04
1 000 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.500%, 03/04/28	948 770	0,11	300 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.875%, 17/01/31	253 077	0,03
300 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 2.000%, 01/12/29	290 355	0,03	300 000 EUR	Enel Finance International NV, 4.000%, 20/02/31	310 146	0,04
156 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 4.500%, 28/10/30	171 754	0,02	700 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.875%, 28/09/34	515 256	0,07
350 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 7.500%, 24/01/33	470 057	0,06	330 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.125%, 17/10/34	255 120	0,03
500 000 EUR	Diageo Capital BV, 0.125%, 28/09/28	440 430	0,05	500 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.250%, 17/01/35	392 255	0,05
200 000 EUR	Diageo Capital BV, 1.500%, 08/06/29	186 190	0,02	400 000 EUR	Enel Finance International NV, 4.500%, 20/02/43	412 588	0,05
300 000 EUR	Diageo Capital BV, 1.875%, 08/06/34	266 274	0,03	300 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.375%, perpetual	258 267	0,03
400 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 0.625%, 15/07/25	378 936	0,04	200 000 EUR	Essity Capital BV, 3.000%, 21/09/26	199 456	0,02
110 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 1.250%, 01/02/31	92 022	0,01	200 000 EUR	Essity Capital BV, 0.250%, 15/09/29	173 926	0,02
223 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 1.000%, 15/01/32	177 617	0,02	410 000 EUR	Euronext NV, 1.000%, 18/04/25	396 158	0,05
155 000 EUR	Digital Intrepid Holding BV, 0.625%, 15/07/31	121 602	0,01	300 000 EUR	Euronext NV, 1.125%, 12/06/29	273 921	0,03
150 000 EUR	DSM BV, 1.000%, 09/04/25	145 790	0,02	300 000 EUR	Evonik Industries AG, 0.750%, 07/09/28	275 349	0,03
600 000 EUR	DSM BV, 0.750%, 28/09/26	570 168	0,07	425 000 EUR	Exor NV, 0.875%, 19/01/31	366 078	0,04
165 000 EUR	DSM BV, 0.250%, 23/06/28	148 521	0,02	240 000 EUR	Exor NV, 1.750%, 14/10/34	200 902	0,02
210 000 EUR	DSM BV, 0.625%, 23/06/32	173 408	0,02	300 000 EUR	EXOR NV, 2.250%, 29/04/30	282 699	0,03
285 000 EUR	DSV Finance BV, 1.375%, 16/03/30	257 896	0,03	180 000 EUR	Ferrovial SE, 4.375%, 13/09/30	189 855	0,02
150 000 EUR	DSV Finance BV, 0.500%, 03/03/31	125 423	0,01	205 000 EUR	Givaudan Finance Europe BV, 1.000%, 22/04/27	194 481	0,02
500 000 EUR	DSV Finance BV, 0.750%, 05/07/33	398 980	0,05	200 000 EUR	Givaudan Finance Europe BV, 4.125%, 28/11/33	213 130	0,03
410 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.625%, 30/05/26	398 315	0,05	280 000 EUR	Global Switch Finance BV, 1.375%, 07/10/30	252 986	0,03
1 060 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.500%, 31/07/29	985 588	0,12	200 000 EUR	H&M Finance BV, 4.875%, 25/10/31	213 666	0,03
250 000 EUR	E.ON International Finance BV, 5.750%, 14/02/33	297 792	0,04				
400 000 EUR	Easyjet Finco Bv, 1.875%, perpetual	373 872	0,04				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
700 000 EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 1.250%, 29/03/26	671 545	0,08	200 000 EUR	ING Groep NV, 5.000%, 20/02/35	206 374	0,02
300 000 EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 1.750%, 29/03/30	276 423	0,03	800 000 EUR	ING Groep NV, 0.250%, perpetual	694 192	0,08
380 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 0.625%, 24/07/25	336 840	0,04	500 000 EUR	ING Groep NV, 4.500%, perpetual	515 315	0,06
200 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 1.375%, 03/03/27	158 468	0,02	500 000 EUR	ING Groep NV, 4.750%, perpetual	531 945	0,06
200 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 1.375%, 24/07/28	143 284	0,02	190 000 EUR	ISS Finance BV, 1.250%, 07/07/25	182 807	0,02
400 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 1.625%, 13/10/31	251 604	0,03	500 000 EUR	JAB Holdings BV, 2.000%, 18/05/28	475 675	0,06
540 000 EUR	Heineken NV, 1.625%, 30/03/25	528 579	0,06	200 000 EUR	JAB Holdings BV, 2.500%, 25/06/29	192 248	0,02
390 000 EUR	Heineken NV, 1.000%, 04/05/26	372 017	0,04	300 000 EUR	JAB Holdings BV, 1.000%, 14/07/31	254 235	0,03
100 000 EUR	Heineken NV, 3.625%, 15/11/26	101 582	0,01	200 000 EUR	JAB Holdings BV, 4.750%, 29/06/32	212 836	0,03
110 000 EUR	Heineken NV, 1.375%, 29/01/27	104 786	0,01	500 000 EUR	JAB Holdings BV, 5.000%, 12/06/33	539 000	0,06
320 000 EUR	Heineken NV, 2.250%, 30/03/30	306 790	0,04	400 000 EUR	JAB Holdings BV, 3.375%, 17/04/35	380 956	0,04
500 000 EUR	Heineken NV, 3.875%, 23/09/30	523 495	0,06	200 000 EUR	JAB Holdings BV, 2.250%, 19/12/39	155 688	0,02
500 000 EUR	Heineken NV, 4.125%, 23/03/35	536 030	0,06	200 000 EUR	JDE Peet's NV, 0.010%, 16/01/26	186 952	0,02
400 000 EUR	Iberdrola International BV, 0.375%, 15/09/25	382 288	0,05	400 000 EUR	JDE Peet's NV, 0.625%, 09/02/28	358 396	0,04
800 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.125%, 21/04/26	771 080	0,09	300 000 EUR	JDE Peet's NV, 0.500%, 16/01/29	259 887	0,03
400 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.450%, 31/12/99	364 104	0,04	200 000 EUR	JDE Peet's NV, 4.125%, 23/01/30	205 508	0,02
400 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.825%, perpetual	340 564	0,04	200 000 EUR	JDE Peet's NV, 1.125%, 16/06/33	160 206	0,02
500 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.874%, perpetual	470 575	0,06	200 000 EUR	JDE Peet's NV, 4.500%, 23/01/34	210 082	0,02
500 000 EUR	Iberdrola International BV, 2.250%, perpetual	446 265	0,05	390 000 EUR	JT International Financial Services BV, 1.000%, 26/11/29	345 782	0,04
200 000 EUR	Iberdrola International BV, 3.250%, perpetual	197 446	0,02	200 000 EUR	JT International Financial Services BV, 2.375%, 07/04/81	190 816	0,02
300 000 EUR	IMCD NV, 2.125%, 31/03/27	286 692	0,03	200 000 EUR	JT International Financial Services BV, 2.875%, 07/10/83	183 238	0,02
180 000 EUR	IMCD NV, 4.875%, 18/09/28	188 671	0,02	280 000 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.250%, 26/06/25	268 708	0,03
300 000 EUR	Imperial Brands Finance Netherlands BV, 1.750%, 18/03/33	234 357	0,03	450 000 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1.125%, 19/03/26	433 575	0,05
300 000 EUR	Imperial Brands Finance Netherlands BV, 5.250%, perpetual	310 503	0,04	100 000 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1.750%, 02/04/27	96 621	0,01
600 000 EUR	ING Bank NV, 4.125%, 02/10/26	614 676	0,07	400 000 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 3.500%, 04/04/28	408 308	0,05
200 000 EUR	Ing Groep NV, 1.750%, 16/02/31	178 756	0,02	200 000 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.375%, 18/03/30	169 340	0,02
300 000 EUR	ING Groep NV, 2.125%, 10/01/26	293 841	0,03	300 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 0.625%, 09/04/25	289 284	0,03
600 000 EUR	ING Groep NV, 2.125%, 23/05/26	587 028	0,07	200 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 1.125%, 11/09/28	184 564	0,02
600 000 EUR	ING Groep NV, 1.250%, 16/02/27	570 642	0,07	200 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 0.875%, 14/12/32	162 946	0,02
400 000 EUR	ING Groep NV, 4.875%, 14/11/27	414 856	0,05	200 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 0.875%, 15/11/33	239 100	0,03
500 000 EUR	ING Groep NV, 1.375%, 11/01/28	470 375	0,06	590 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 0.500%, 22/05/26	550 081	0,06
800 000 EUR	ING Groep NV, 2.000%, 20/09/28	760 448	0,09	365 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 1.375%, 02/05/28	337 165	0,04
700 000 EUR	ING Groep NV, 0.375%, 29/09/28	621 369	0,07	350 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 2.000%, 30/03/30	318 258	0,04
400 000 EUR	ING Groep NV, 0.250%, 01/02/30	337 316	0,04				
600 000 EUR	ING Groep NV, 2.000%, 22/03/30	580 230	0,07				
200 000 EUR	ING Groep NV, 1.000%, 13/11/30	187 370	0,02				
400 000 EUR	ING Groep NV, 2.125%, 26/05/31	381 592	0,04				
500 000 EUR	ING Groep NV, 4.125%, 24/08/33	501 675	0,06				
600 000 EUR	ING Groep NV, 5.250%, 14/11/33	658 686	0,08				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
200 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 4.250%, 08/09/31	204 794	0,02	300 000 EUR	Naturgy Finance BV, 0.750%, 28/11/29	264 228	0,03
390 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 3.500%, 09/04/25	389 700	0,05	200 000 EUR	Ne Property BV, 2.000%, 20/01/30	161 112	0,02
200 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 2.125%, 06/05/25	196 404	0,02	200 000 EUR	NE Property BV, 1.875%, 09/10/26	182 698	0,02
405 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 0.250%, 23/02/26	377 367	0,04	150 000 EUR	NE Property BV, 3.375%, 14/07/27	141 291	0,02
300 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 0.250%, 07/09/26	275 586	0,03	400 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.875%, 08/07/25	382 504	0,05
200 000 EUR	Lseg Netherlands BV, 4.125%, 29/09/26	205 152	0,02	600 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.250%, 09/09/26	548 718	0,06
200 000 EUR	Lseg Netherlands BV, 4.231%, 29/09/30	211 122	0,03	100 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.875%, 24/06/27	91 077	0,01
680 000 EUR	LYB International Finance II BV, 0.875%, 17/09/26	637 044	0,08	200 000 EUR	NN Group NV, 1.625%, 01/06/27	192 386	0,02
410 000 EUR	LYB International Finance II BV, 1.625%, 17/09/31	356 208	0,04	200 000 EUR	NN Group NV, 1.625%, 01/06/27	192 386	0,02
220 000 EUR	Madrilena Red de Gas Finance BV, 1.375%, 11/04/25	212 115	0,03	200 000 EUR	NN Group NV, 0.875%, 23/11/31	171 470	0,02
100 000 EUR	Madrilena Red de Gas Finance BV, 2.250%, 11/04/29	89 405	0,01	300 000 EUR	NN Group NV, 5.250%, 01/03/43	306 396	0,04
340 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.000%, 11/11/25	326 318	0,04	300 000 EUR	NN Group NV, 6.000%, 03/11/43	319 776	0,04
340 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.375%, 26/06/26	326 594	0,04	300 000 EUR	NN Group NV, 4.500%, perpetual	298 815	0,04
150 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.500%, 09/02/27	144 141	0,02	800 000 EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 0.750%, 31/03/25	775 608	0,09
630 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.625%, 06/05/27	586 536	0,07	200 000 EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 1.125%, 30/09/27	189 542	0,02
200 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.400%, perpetual	199 806	0,02	200 000 EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 0.125%, 04/06/28	179 586	0,02
300 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.500%, perpetual	303 189	0,04	500 000 EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 1.375%, 31/03/30	464 720	0,05
510 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.700%, perpetual	533 062	0,06	300 000 EUR	PACCAR Financial Europe BV, 0.010%, 01/03/26	280 335	0,03
300 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.250%, 09/09/29	258 411	0,03	200 000 EUR	PACCAR Financial Europe BV, 3.375%, perpetual	201 948	0,02
110 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.875%, 01/10/31	93 253	0,01	200 000 EUR	Prosus NV, 1.207%, 19/01/26	187 974	0,02
300 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 1.250%, 09/09/41	212 463	0,03	300 000 EUR	Prosus NV, 2.031%, 03/08/32	229 980	0,03
400 000 EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands, 0.375%, 26/02/25	385 372	0,05	300 000 EUR	Prosus NV, 1.985%, 13/07/33	221 622	0,03
200 000 EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands, 0.500%, 21/09/28	176 420	0,02	500 000 EUR	Prosus NV, 2.778%, 19/01/34	389 815	0,05
200 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.375%, 21/01/25	195 324	0,02	190 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.375%, 19/05/26	179 185	0,02
300 000 EUR	Naturgy Finance BV, 0.875%, 15/05/25	289 224	0,03	690 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.750%, 19/05/30	604 440	0,07
600 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.250%, 15/01/26	575 154	0,07	200 000 EUR	Redexis Gas Finance BV, 1.875%, 28/05/25	194 870	0,02
100 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.250%, 19/04/26	95 798	0,01	350 000 EUR	Redexis Gas Finance BV, 1.875%, 27/04/27	329 101	0,04
200 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.375%, 19/01/27	189 596	0,02	320 000 EUR	RELX Finance BV, 1.375%, 12/05/26	309 152	0,04
300 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.500%, 29/01/28	282 267	0,03	190 000 EUR	RELX Finance BV, 0.500%, 10/03/28	172 305	0,02
				300 000 EUR	RELX Finance BV, 3.750%, 12/06/31	312 018	0,04
				150 000 EUR	RELX Finance BV, 0.875%, 10/03/32	126 569	0,02
				406 000 EUR	Ren Finance BV, 2.500% 12/02/25	400 982	0,05
				350 000 EUR	Ren Finance BV, 1.750%, 18/01/28	331 954	0,04
				500 000 EUR	Rentokil Initial Finance BV, 4.375%, 27/06/30	528 445	0,06
				300 000 EUR	Repsol International Finance BV 4.500%, 25/03/75	299 031	0,04

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
500 000 EUR	Repsol International Finance BV, 2.500%, perpetual	467 405	0,06	200 000 EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.000%, perpetual	197 360	0,02
500 000 EUR	Repsol International Finance BV 3.750%, perpetual	489 485	0,06	500 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.250%, 10/03/25	493 395	0,06
200 000 EUR	Repsol International Finance BV 4.247%, perpetual	195 046	0,02	200 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.010%, 20/02/26	188 422	0,02
300 000 EUR	REWE International Finance BV 4.875%, 13/09/30	318 048	0,04	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.010%, 20/02/26	94 211	0,01
200 000 EUR	Robert Bosch Investment Nederland BV, 2.625%, 24/05/28	197 802	0,02	900 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.375%, 05/06/26	849 024	0,10
200 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.312%, 04/12/27	204 708	0,02	300 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.625%, 25/02/27	280 629	0,03
300 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.204%, 27/08/29	307 917	0,04	320 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.875%, 10/03/28	323 635	0,04
400 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.355%, 27/02/35	417 440	0,05	200 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.250%, 20/02/29	176 636	0,02
200 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.586%, 04/12/36	211 530	0,03	300 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.125%, 05/09/29	267 588	0,03
200 000 EUR	Sagax Euro Mtn NL BV, 1.000%, 17/05/29	163 504	0,02	300 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.000%, 25/02/30	270 360	0,03
100 000 EUR	SAGAX EURO MTN NL BV, 1.625%, 24/02/26	94 785	0,01	220 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.250%, 28/02/31	198 794	0,02
400 000 EUR	SAGAX EURO MTN NL BV 0.750%, 26/01/28	341 756	0,04	400 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.375%, 24/08/31	412 388	0,05
200 000 EUR	Sandoz Finance BV, 4.220%, 17/04/30	207 328	0,02	300 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.500%, 20/02/32	248 424	0,03
200 000 EUR	Sartorius Finance BV, 4.250%, 14/09/26	204 468	0,02	400 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.000%, 08/09/33	400 024	0,05
200 000 EUR	Sartorius Finance BV, 4.375%, 14/09/29	207 230	0,02	800 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.250%, 25/02/35	667 552	0,08
300 000 EUR	Sartorius Finance BV, 4.500%, 14/09/32	312 426	0,04	300 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.500%, 24/02/36	310 335	0,04
300 000 EUR	Sartorius Finance BV, 4.875%, 14/09/35	316 320	0,04	400 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.750%, 28/02/39	331 560	0,04
300 000 EUR	Schlumberger Finance BV, 1.375%, 28/10/26	286 506	0,03	400 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.625%, 24/02/43	416 228	0,05
250 000 EUR	Schlumberger Finance BV, 0.250%, 15/10/27	226 225	0,03	180 000 EUR	Signify NV, 2.375%, 11/05/27	174 555	0,02
690 000 EUR	Schlumberger Finance BV, 2.000%, 06/05/32	633 910	0,07	300 000 EUR	Sika Capital BV, 3.750%, 03/11/26	304 968	0,04
715 000 EUR	Shell International Finance BV, 0.375%, 15/02/25	692 678	0,08	360 000 EUR	Sika Capital BV, 0.875%, 29/04/27	336 424	0,04
620 000 EUR	Shell International Finance BV, 2.500%, 24/03/26	614 544	0,07	300 000 EUR	Sika Capital BV, 3.750%, 03/05/30	308 754	0,04
900 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.625%, 20/01/27	867 042	0,10	350 000 EUR	Sika Capital BV, 1.500%, 29/04/31	315 059	0,04
400 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.625%, 20/01/27	385 352	0,05	500 000 EUR	Stellantis NV, 0.625%, 30/03/27	460 750	0,05
640 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.500%, 07/04/28	605 370	0,07				
340 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.250%, 12/05/28	317 614	0,04				
230 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.250%, 11/11/32	197 545	0,02				
200 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.250%, 11/11/32	171 778	0,02				
400 000 EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.250%, 05/04/29	389 516	0,05				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
400 000 EUR	Stellantis NV, 4.500%, 07/07/28	421 128	0,05	100 000 EUR	Universal Music Group NV, 3.000%, 30/06/27	100 048	0,01
800 000 EUR	Stellantis NV, 0.750%, 18/01/29	710 864	0,08	400 000 EUR	Universal Music Group NV, 4.000%, 13/06/31	418 028	0,05
222 000 EUR	Stellantis NV, 4.375%, 14/03/30	234 479	0,03	500 000 EUR	Universal Music Group NV, 3.750%, 30/06/32	515 005	0,06
700 000 EUR	Stellantis NV, 4.250%, 16/06/31	726 292	0,09	200 000 EUR	Upjohn Finance BV, 1.362%, 23/06/27	185 684	0,02
600 000 EUR	Stellantis NV, 2.750%, 01/04/32	561 168	0,07	410 000 EUR	Upjohn Finance BV, 1.908%, 23/06/32	344 322	0,04
260 000 EUR	Sudzucker International Finance BV, 1.000%, 28/11/25	247 567	0,03	170 000 EUR	Utah Acquisition Sub Inc, 3.125%, 22/11/28	165 582	0,02
300 000 EUR	Technip Energies NV, 1.125%, 28/05/28	270 615	0,03	250 000 EUR	Vesteda Finance BV, 2.000%, 10/07/26	240 293	0,03
373 000 EUR	Telefonica Europe BV, 5.875%, 14/02/33	447 842	0,05	135 000 EUR	Vesteda Finance BV, 1.500%, 24/05/27	127 302	0,02
180 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.010%, 18/11/25	169 837	0,02	100 000 EUR	Vesteda Finance BV, 0.750%, 18/10/31	80 251	0,01
500 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.800%, 18/10/30	433 955	0,05	500 000 EUR	Via Outlets BV, 1.750%, 15/11/28	444 110	0,05
500 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.125%, 18/10/33	415 200	0,05	500 000 EUR	Viterra Finance BV, 0.375%, 24/09/25	472 120	0,06
700 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.625%, 18/10/41	527 359	0,06	200 000 EUR	Viterra Finance BV, 1.000%, 24/09/28	177 856	0,02
100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 2.000%, 18/10/51	71 570	0,01	300 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.125%, 28/03/25	298 185	0,04
520 000 EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 0.010%, 27/10/25	473 833	0,05	300 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.125%, 15/11/25	303 732	0,04
100 000 EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3.375%, 13/01/26	100 383	0,01	1 000 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.875%, 30/03/27	955 820	0,11
300 000 EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 4.000%, 02/04/27	309 174	0,04	300 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.250%, 29/03/29	311 865	0,04
500 000 EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3.500%, 13/01/28	509 355	0,06	300 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.625%, 16/01/30	271 317	0,03
155 000 EUR	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 3.625%, perpetual	155 448	0,02	600 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.375%, 15/05/30	572 548	0,06
340 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.250%, 25/03/25	331 507	0,04	800 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.250%, 18/11/30	791 408	0,09
200 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.750%, 28/02/26	191 110	0,02	100 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.250%, 23/09/32	83 216	0,01
300 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.125%, 12/02/27	285 534	0,03	300 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.300%, 22/03/33	295 887	0,03
200 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.125%, 29/04/28	186 978	0,02	1 000 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.125%, 16/11/38	1 035 300	0,12
230 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.750%, 16/11/28	219 756	0,03	300 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.500%, 21/01/41	213 489	0,03
100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.375%, 31/07/29	92 794	0,01	550 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.625%, perpetual	545 341	0,06
300 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.750%, 25/03/30	281 508	0,03	400 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.500%, perpetual	357 832	0,04
150 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.375%, 04/09/30	136 944	0,02	500 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.748%, perpetual	468 330	0,06
300 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 3.250%, 23/02/31	306 747	0,03	700 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.875%, perpetual	666 904	0,08
190 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.250%, 28/02/31	169 708	0,02	700 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.625%, perpetual	678 174	0,08
300 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.625%, 12/02/33	269 370	0,03	300 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 7.500%, perpetual	326 223	0,04
300 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 2.250%, 16/05/34	280 854	0,03				
100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 3.500%, 23/02/35	104 366	0,01				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
200 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 7.875%, perpetual	225 048	0,03	200 000 EUR	Wurth Finance International BV 0.750%, 22/11/27	184 766	0,02
900 000 EUR	VolkswAGen nternational Finance NV, 3.875%, perpetual	824 580	0,10	300 000 EUR	Wurth Finance International BV, 2.125%, 23/08/30	282 456	0,03
300 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.800%, 29/06/25	290 211	0,03	Pays-Bas – Total			
200 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.125%, 08/09/25	191 450	0,02	Nouvelle-Zélande			
300 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.500%, 22/03/26	286 914	0,03	190 000 EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 1.125%, 20/03/25	184 433	0,02
300 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.500%, 10/06/26	286 161	0,03	130 000 EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.375%, 17/09/29	111 409	0,02
600 000 EUR	Vonovia Finance BV, 0.625%, 09/07/26	559 566	0,07	500 000 EUR	ASB Bank Ltd, 0.250%, 08/09/28	435 845	0,05
200 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.750%, 25/01/27	190 058	0,02	290 000 EUR	ASB Bank Ltd, 0.500%, 24/09/29	249 942	0,03
100 000 EUR	Vonovia Finance BV, 0.625%, 07/10/27	89 507	0,01	450 000 EUR	Chorus Ltd, 0.875%, 05/12/26	419 913	0,05
300 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.500%, 14/01/28	274 761	0,03	100 000 EUR	Chorus Ltd, 3.625%, 07/09/29	101 642	0,01
200 000 EUR	Vonovia Finance BV, 2.250%, 07/04/30	179 838	0,02	Nouvelle-Zélande – Total			
200 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.000%, 09/07/30	165 782	0,02	Norvège			
300 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.125%, 14/09/34	223 719	0,03	500 000 EUR	DNB Bank ASA, 1.625%, 31/05/26	486 890	0,06
800 000 EUR	Vonovia Finance BV, 2.750%, 22/03/38	673 360	0,08	600 000 EUR	DNB Bank ASA, 3.625%, 16/02/27	601 890	0,07
300 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.625%, 07/10/39	206 718	0,02	400 000 EUR	DNB Bank ASA, 3.125%, 21/09/27	398 728	0,05
100 000 EUR	Wabtec Transportation Netherlands BV, 1.250%, 03/12/27	92 144	0,01	400 000 EUR	DNB Bank ASA, 4.500%, 19/07/28	413 372	0,05
300 000 EUR	Wintershall Dea Finance BV, 0.840%, 25/09/25	285 900	0,03	300 000 EUR	DNB Bank ASA, 0.250%, 23/02/29	263 145	0,03
300 000 EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.332%, 25/09/28	268 302	0,03	200 000 EUR	DNB Bank ASA, 4.625%, 01/11/29	210 208	0,03
300 000 EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.823%, 25/09/31	258 342	0,03	300 000 EUR	DNB Bank ASA, 4.625%, 28/02/33	307 179	0,04
500 000 EUR	Wolters Kluwer NV, 3.000%, 23/09/26	500 890	0,06	663 000 EUR	DNB Bank ASA, 5.000%, 13/09/33	690 183	0,08
100 000 EUR	Wolters Kluwer NV, 1.500%, 22/03/27	95 573	0,01	190 000 EUR	Norsk Hydro ASA, 1.125%, 11/04/25	183 601	0,02
100 000 EUR	Wolters Kluwer NV, 0.250%, 30/03/28	89 744	0,01	280 000 EUR	Norsk Hydro ASA, 2.000%, 11/04/29	258 188	0,03
300 000 EUR	Wolters Kluwer NV, 3.750%, perpetual	311 124	0,04	200 000 EUR	Santander Consumer Bank AS, 0.125%, 25/02/25	191 934	0,02
510 000 EUR	WPC Eurobond BV, 2.250%, 09/04/26	493 583	0,06	200 000 EUR	Santander Consumer Bank AS, 0.500%, 11/08/25	190 136	0,02
390 000 EUR	WPC Eurobond BV, 2.125%, 15/04/27	370 270	0,04	200 000 EUR	Santander Consumer Bank AS, 0.125%, perpetual	185 316	0,02
255 000 EUR	WPC Eurobond BV, 0.950%, 01/06/30	211 742	0,03	200 000 EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 1.750%, 27/04/27	190 204	0,02
150 000 EUR	Wurth Finance International BV, 1.000%, 26/05/25	145 367	0,02	400 000 EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 0.125%, 03/03/28	351 500	0,04
				200 000 EUR	SpareBank 1 SMN, 3.125%, 22/12/25	198 760	0,02
				410 000 EUR	SpareBank 1 SMN, 0.125%, 11/09/26	377 331	0,04
				225 000 EUR	SpareBank 1 SMN, 0.010%, 18/02/28	197 608	0,02
				200 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 2.875%, 20/09/25	198 180	0,02
				600 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.250%, 09/11/26	551 340	0,07
				400 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 4.875%, 24/08/28	421 088	0,05
				400 000 EUR	Var Energi ASA, 5.500%, perpetual	427 900	0,05
				Norvège – Total			
						7 294 681	0,85

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Pologne				Espagne (suite)			
300 000 EUR	ORLEN SA, 4.750%, 13/07/30	311 331	0,04	300 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.875%, 26/03/32	259 911	0,03
300 000 EUR	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA, 5.625%, 01/02/26	303 522	0,03	100 000 EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 0.375%, 07/10/27	89 619	0,01
Pologne – Total			0,07	300 000 EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 3.750%, 25/04/30	296 142	0,04
Portugal				200 000 EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 5.125%, 23/04/31	211 102	0,03
200 000 EUR	Banco Comercial Portugues SA, 5.625%, 02/10/26	205 636	0,03	400 000 EUR	ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA, 1.875%, 20/04/26	387 152	0,05
200 000 EUR	Banco Comercial Portugues SA, 1.125%, 12/02/27	189 064	0,02	200 000 EUR	Amadeus IT Group SA, 2.875%, 20/05/27	198 250	0,02
200 000 EUR	Banco Comercial Portugues SA, 1.750%, 07/04/28	186 808	0,02	300 000 EUR	Amadeus IT Group SA, 1.875%, 24/09/28	286 182	0,03
100 000 EUR	Brisa-Concessao Rodoviaria SA, 1.875%, 30/04/25	97 878	0,01	700 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.375%, 14/05/25	679 049	0,08
300 000 EUR	EDP – Energias de Portugal SA, 1.625%, 15/04/27	287 055	0,03	500 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.750%, 04/06/25	481 905	0,06
300 000 EUR	EDP – Energias de Portugal SA, 3.875%, 26/06/28	308 310	0,04	500 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.000%, 21/06/26	474 885	0,06
300 000 EUR	Fidelidade - Cia de Seguros SA/Portugal, 4.250%, 04/09/31	267 474	0,03	300 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.375%, 15/11/26	277 815	0,03
Portugal – Total			0,18	300 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.125%, 24/03/27	279 351	0,03
Roumanie				400 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.875%, 14/01/29	362 676	0,04
400 000 EUR	Banca Comerciala Romana SA, 7.625%, perpetual	422 336	0,05	300 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.000%, 16/01/30	288 540	0,03
Roumanie – Total			0,05	500 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.625%, 13/01/31	524 460	0,06
Slovaquie				700 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5.750%, 15/09/33	736 183	0,09
100 000 EUR	Slovenska Sporitelna AS, 5.375%, 04/10/28	103 123	0,01	500 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.125%, perpetual	503 190	0,06
400 000 EUR	Tatra Banka as, 5.952%, 17/02/26	405 052	0,05	600 000 EUR	BanCo Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.375%, 20/09/27	605 676	0,07
Slovaquie – Total			0,06	500 000 EUR	BanCo Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.375%, 14/10/29	531 090	0,06
Slovénie				300 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 1.125%, 11/03/27	284 715	0,03
200 000 EUR	Nova Kreditna Banka Maribor dd, 7.375%, 29/06/26	206 492	0,02	100 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 5.125%, 10/11/28	105 121	0,01
Slovénie – Total			0,02	100 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 5.125%, 10/11/28	105 121	0,01
Espagne				200 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 5.000%, 07/06/29	210 224	0,03
200 000 EUR	Abanca Corp Bancaria SA, 5.250%, 14/09/28	207 370	0,02	600 000 EUR	Banco Santander SA, 2.500%, 18/03/25	591 720	0,07
200 000 EUR	Abanca Corp Bancaria SA, 5.875%, 02/04/30	213 106	0,03	1 500 000 EUR	Banco Santander SA, 3.750%, 16/01/26	1 512 705	0,18
200 000 EUR	Abanca Corp Bancaria SA, 5.500%, perpetual	203 166	0,02	400 000 EUR	Banco Santander SA, 3.250%, 04/04/26	397 492	0,05
200 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 0.625%, 15/07/25	191 526	0,02	400 000 EUR	Banco Santander SA, 3.125%, 19/01/27	396 636	0,05
600 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.000%, 27/02/27	564 108	0,07	500 000 EUR	Banco Santander SA, 0.500%, 04/02/27	458 770	0,05
100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 4.125%, 31/01/28	102 859	0,01	300 000 EUR	Banco Santander SA, 0.500%, 24/03/27	279 975	0,03
200 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.250%, 07/02/28	184 382	0,02				
500 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.125%, 26/03/28	458 020	0,05				
500 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.625%, 15/07/29	453 590	0,05				
800 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 3.000%, 27/03/31	762 696	0,09				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Espagne (suite)				Espagne (suite)			
400 000 EUR	Banco Santander SA, 4.625%, 18/10/27	409 812	0,05	200 000 EUR	Ferrovial Emisiones SA, 0.540%, 12/11/28	177 352	0,02
500 000 EUR	Banco Santander SA, 3.875%, 16/01/28	511 930	0,06	500 000 EUR	Ibercaja Banco SA, 5.625%, 07/06/27	515 650	0,06
400 000 EUR	Banco Santander SA, 2.125%, 08/02/28	378 548	0,04	500 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.000%, 07/03/25	485 985	0,06
700 000 EUR	Banco Santander SA, 4.250%, 12/06/30	731 423	0,09	200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 0.875%, 16/06/25	192 884	0,02
300 000 EUR	Banco Santander SA, 1.625%, 22/10/30	258 399	0,03	200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.125%, 22/11/28	202 586	0,02
700 000 EUR	Banco Santander SA, 4.875%, 18/10/31	745 367	0,09	300 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.375%, 11/03/32	266 118	0,03
1 000 000 EUR	Banco Santander SA, 1.000%, 04/11/31	856 350	0,10	300 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.375%, 22/11/32	306 024	0,04
500 000 EUR	Banco Santander SA, 5.750%, perpetual	524 285	0,06	500 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.625%, 13/07/33	518 130	0,06
600 000 EUR	Bankinter SA, 0.875%, 08/07/26	564 330	0,07	300 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 4.875%, perpetual	302 676	0,04
200 000 EUR	Bankinter SA, 4.375%, 03/05/30	207 430	0,02	500 000 EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 1.350%, 14/10/28	461 130	0,05
300 000 EUR	Bankinter SA, 4.875%, 13/09/31	314 169	0,04	300 000 EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 2.500%, 28/11/29	282 693	0,03
300 000 EUR	CaixaBank SA, 0.375%, 03/02/25	289 656	0,03	500 000 EUR	Kutxabank SA, 4.750%, 15/06/27	508 790	0,06
300 000 EUR	CaixaBank SA, 1.125%, 27/03/26	285 693	0,03	200 000 EUR	Kutxabank SA, 0.500%, 14/10/27	182 272	0,02
600 000 EUR	CaixaBank SA, 1.625%, 13/04/26	583 944	0,07	200 000 EUR	Kutxabank SA, 4.000%, 01/02/28	202 286	0,02
1 000 000 EUR	CaixaBank SA, 1.375%, 19/06/26	949 680	0,11	300 000 EUR	Mapfre SA, 1.625%, 19/05/26	293 481	0,04
300 000 EUR	CaixaBank SA, 0.750%, 09/07/26	281 853	0,03	200 000 EUR	Mapfre SA, 2.875%, 13/04/30	182 502	0,02
300 000 EUR	CaixaBank SA, 0.750%, 10/07/26	288 309	0,03	300 000 EUR	Mapfre SA, 4.125%, 07/09/48	289 590	0,03
300 000 EUR	CaixaBank SA, 1.125%, 12/11/26	281 772	0,03	200 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 1.875%, 02/11/26	192 526	0,02
600 000 EUR	CaixaBank SA, 0.375%, 18/11/26	564 702	0,07	300 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 2.375%, 13/07/27	288 759	0,03
500 000 EUR	CaixaBank SA, 0.625%, 21/01/28	461 225	0,05	100 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 2.375%, 18/09/29	94 717	0,01
800 000 EUR	CaixaBank SA, 0.500%, 09/02/29	705 144	0,08	200 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 1.375%, 01/06/30	169 560	0,02
300 000 EUR	CaixaBank SA, 5.000%, 19/07/29	313 662	0,04	200 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 1.875%, 04/12/34	158 148	0,02
500 000 EUR	CaixaBank SA, 3.750%, 07/09/29	512 805	0,06	150 000 EUR	NorteGas Energia Distribucion SA, 2.065%, 28/09/27	141 143	0,02
300 000 EUR	CaixaBank SA, 2.250%, 17/04/30	289 644	0,03	200 000 EUR	NorteGas Energia Distribucion SA, 0.905%, 22/01/31	159 460	0,02
300 000 EUR	CaixaBank SA, 4.250%, 06/09/30	311 433	0,04	300 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.125%, 24/04/25	291 768	0,03
300 000 EUR	CaixaBank SA, 4.375%, 29/11/33	315 243	0,04	400 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.000%, 21/04/26	384 164	0,05
1 000 000 EUR	CaixaBank SA, 6.125%, 30/05/34	1 057 820	0,12	300 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.500%, 24/05/33	245 910	0,03
200 000 EUR	CaixaBank SA, 5.125%, 19/07/34	213 422	0,03	300 000 EUR	Redeia Corp SA, 4.625%, perpetual	305 367	0,04
100 000 EUR	EDP - Energias de Portugal SA, 2.875%, 01/06/26	99 159	0,01	200 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.010%, 23/02/26	186 608	0,02
200 000 EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 4.125%, 04/04/29	208 192	0,03	300 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.500%, 14/01/27	275 967	0,03
200 000 EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 4.375%, 04/04/32	213 120	0,03	400 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 4.125%, perpetual	413 220	0,05
500 000 EUR	Enagas Financiaciones SA, 1.250%, 06/02/25	487 250	0,06				
200 000 EUR	Enagas Financiaciones SA, 0.375%, 05/11/32	158 842	0,02				
190 000 EUR	FCC Aqualia SA, 2.629%, 08/06/27	185 769	0,02				
570 000 EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 1.661%, 04/12/26	543 301	0,06				
200 000 EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 5.250%, 30/10/29	214 674	0,03				
300 000 EUR	Ferrovial Emisiones SA, 1.375%, 31/03/25	292 002	0,03				
600 000 EUR	Ferrovial Emisiones SA, 1.382%, 14/05/26	577 866	0,07				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Espagne (suite)				Suède (suite)			
300 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.495%, 11/09/25	291 528	0,03	100 000 EUR	INVEstor AB, 2.750%, 10/06/32	97 136	0,01
1 000 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.460%, 13/04/26	965 110	0,11	350 000 EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.125%, 19/02/25	335 818	0,04
300 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.201%, 21/08/27	279 996	0,03	200 000 EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.050%, 15/04/26	184 856	0,02
400 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.318%, 17/10/28	385 540	0,05	480 000 EUR	Molnlycke Holding AB, 1.875%, 28/02/25	468 797	0,06
500 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.788%, 12/03/29	470 765	0,06	140 000 EUR	Molnlycke Holding AB, 4.250%, 08/09/28	143 737	0,02
600 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.932%, 17/10/29	593 532	0,07	155 000 EUR	Molnlycke Holding AB, 0.875%, 05/09/29	133 469	0,02
400 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 0.664%, 03/02/30	345 648	0,04	500 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.625%, 18/08/31	459 540	0,05
200 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.930%, 17/10/31	182 668	0,02	350 000 EUR	Sagax AB, 2.250%, 13/03/25	340 427	0,04
600 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.807%, 21/05/32	538 596	0,06	100 000 EUR	Sandvik AB, 3.000%, 18/06/26	99 033	0,01
380 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.957%, 01/07/39	304 680	0,04	500 000 EUR	Sandvik AB, 3.750%, 27/09/29	517 050	0,06
200 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.864%, 13/07/40	156 082	0,02	680 000 EUR	Securitas AB, 1.250%, 06/03/25	658 315	0,08
500 000 EUR	Unicaja Banco SA, 1.000%, 01/12/26	472 400	0,06	230 000 EUR	Securitas AB, 0.250%, 22/02/28	202 662	0,02
100 000 EUR	Unicaja Banco SA, 5.125%, 21/02/29	102 681	0,01	300 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.250%, 24/11/25	300 219	0,04
300 000 EUR	Werfen SA/Spain, 4.625%, 06/06/28	305 688	0,04	100 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.000%, 09/11/26	101 748	0,01
Espagne – Total		45 417 085	5,32	505 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.375%, 11/02/27	460 297	0,05
Suède				478 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.125%, 29/06/27	492 350	0,06
550 000 EUR	Akelius Residential Property AB, 1.750%, 07/02/25	533 208	0,06	300 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.750%, 09/08/27	272 904	0,03
265 000 EUR	Alfa Laval Treasury International AB, 0.875%, 18/02/26	253 184	0,03	540 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.375%, 21/06/28	472 073	0,06
100 000 EUR	Alfa Laval Treasury International AB, 1.375%, 18/02/29	91 628	0,01	630 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.625%, 12/11/29	537 358	0,06
220 000 EUR	Assa Abloy AB, 3.750%, 13/09/26	224 136	0,03	400 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.625%, 12/11/29	341 180	0,04
220 000 EUR	Assa Abloy AB, 3.875%, 13/09/30	231 007	0,03	300 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.750%, 03/11/31	273 075	0,03
220 000 EUR	Assa Abloy AB, 4.125%, 13/09/35	241 344	0,03	200 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 5.000%, 17/08/33	207 900	0,03
180 000 EUR	Atlas Copco AB, 0.625%, 30/08/26	169 852	0,02	300 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.875%, perpetual	307 236	0,04
290 000 EUR	Castellum AB, 0.750%, 04/09/26	262 523	0,03	100 000 EUR	SKF AB, 1.250%, 17/09/25	96 543	0,01
200 000 EUR	Electrolux AB, 4.125%, 05/10/26	203 030	0,02	300 000 EUR	SKF AB, 3.125%, 14/09/28	300 012	0,04
200 000 EUR	Electrolux AB, 2.500%, 18/05/30	183 676	0,02	100 000 EUR	SKF AB, 0.875%, 15/11/29	87 500	0,01
200 000 EUR	EQT AB, 0.875%, 14/05/31	158 720	0,02	100 000 EUR	SKF AB, 0.250%, 15/02/31	79 617	0,01
400 000 EUR	EQT AB, 2.875%, 06/04/32	355 692	0,04	210 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.050%, 03/09/26	193 145	0,02
190 000 EUR	Essity AB, 1.125%, 05/03/25	184 610	0,02	350 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.125%, 03/11/26	321 650	0,04
200 000 EUR	Essity AB, 0.250%, 08/02/31	170 356	0,02	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.875%, 10/05/27	102 045	0,01
180 000 EUR	Fastighets AB Balder, 1.875%, 14/03/25	171 911	0,02	500 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.750%, 01/11/27	513 025	0,06
180 000 EUR	Fastighets AB Balder, 1.875%, 23/01/26	164 133	0,02	280 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.010%, 02/12/27	247 696	0,03
300 000 EUR	Fastighets AB Balder, 1.250%, 28/01/28	244 221	0,03	300 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.375%, 17/02/28	302 766	0,04
300 000 EUR	Hemso Fastighets AB, 1.000%, 09/09/26	277 905	0,03				
480 000 EUR	Investor AB, 1.500%, 12/09/30	436 685	0,05				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Suède (suite)				Royaume-Uni			
300 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.050%, 06/09/28	261 069	0,03	400 000 EUR	3i Group PLC, 4.875%, 14/06/29	418 052	0,05
290 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.375%, 23/02/29	264 848	0,03	290 000 EUR	Ancor UK Finance PLC, 1.125%, 23/06/27	270 092	0,03
300 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 2.625%, 05/09/29	293 025	0,03	200 000 EUR	Anglo American Capital PLC, 4.500%, 15/09/28	207 776	0,02
300 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.250%, 01/06/33	292 497	0,03	500 000 EUR	Anglo American Capital PLC, 5.000%, 15/03/31	532 525	0,06
500 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 5.000%, 16/08/34	524 155	0,06	290 000 EUR	Anglo American Capital PLC, 4.750%, 21/09/32	304 697	0,04
700 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.750%, perpetual	708 876	0,08	250 000 EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.200%, 23/09/27	223 585	0,03
300 000 EUR	Swedbank AB, 0.750%, 05/05/25	289 206	0,03	590 000 EUR	Aon Global Ltd, 2.875%, 14/05/26	580 324	0,07
300 000 EUR	Swedbank AB, 3.750%, 14/11/25	302 559	0,04	500 000 EUR	AstraZeneca PLC, 3.625%, 03/03/27	511 505	0,06
300 000 EUR	Swedbank AB, 0.250%, 02/11/26	276 840	0,03	300 000 EUR	AstraZeneca PLC, 1.250%, 12/05/28	282 237	0,03
200 000 EUR	Swedbank AB, 1.300%, 17/02/27	186 186	0,02	300 000 EUR	AstraZeneca PLC, 0.375%, 03/06/29	263 955	0,03
300 000 EUR	Swedbank AB, 2.100%, 25/05/27	288 759	0,03	751 000 EUR	Aviva PLC, 3.375%, 04/12/45	732 202	0,09
500 000 EUR	Swedbank AB, 4.250%, 11/07/28	513 690	0,06	830 000 EUR	Barclays PLC, 1.375%, 24/01/26	806 129	0,10
400 000 EUR	Swedbank AB, 4.375%, 05/09/30	414 628	0,05	280 000 EUR	Barclays PLC, 2.885%, 31/01/27	275 321	0,03
300 000 EUR	Swedbank AB, 3.625%, 23/08/32	293 271	0,03	100 000 EUR	Barclays PLC, 0.877%, 28/01/28	91 799	0,01
1 000 000 EUR	Swedbank AB, 4.625%, perpetual	1 010 490	0,12	500 000 EUR	Barclays PLC, 0.577%, 09/08/29	430 375	0,05
110 000 EUR	Tele2 AB, 2.125%, 15/05/28	105 317	0,01	500 000 EUR	Barclays PLC, 4.918%, 08/08/30	521 200	0,06
200 000 EUR	Tele2 AB, 0.750%, 23/03/31	167 194	0,02	400 000 EUR	Barclays PLC, 1.106%, 12/05/32	326 120	0,04
200 000 EUR	Tele2 AB, 3.750%, perpetual	205 260	0,02	400 000 EUR	Barclays PLC, 5.262%, 29/01/34	428 256	0,05
200 000 EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 5.375%, 29/05/28	208 998	0,03	300 000 EUR	BAT International Finance PLC, 2.750%, 25/03/25	296 004	0,04
200 000 EUR	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 1.000%, 26/05/29]	169 444	0,02	400 000 EUR	BAT International Finance PLC, 2.250%, 16/01/30	355 960	0,04
400 000 EUR	Telia Co AB, 3.875%, 01/10/25	404 692	0,05	500 000 EUR	BAT International FINANCE PLC, 3.125%, 06/03/29	484 025	0,06
400 000 EUR	Telia Co AB, 3.625%, 22/02/32	414 048	0,05	550 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.953%, 03/03/25	540 144	0,06
470 000 EUR	Telia Co AB, 3.500%, 05/09/33	482 023	0,06	690 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 2.972%, 27/02/26	685 777	0,08
200 000 EUR	Telia Co AB, 1.625%, 23/02/35	169 050	0,02	340 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.573%, 16/02/27	324 584	0,04
300 000 EUR	Telia Co AB, 4.625%, 21/12/82	299 229	0,04	340 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 2.519%, 07/04/28	333 768	0,04
350 000 EUR	Volvo Treasury AB, 1.625%, 26/05/25	341 390	0,04	190 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.231%, 08/05/31	165 862	0,02
360 000 EUR	Volvo Treasury AB, 1.625%, 18/09/25	349 801	0,04	800 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 2.822%, 07/04/32	777 664	0,09
200 000 EUR	Volvo Treasury AB, 2.625%, 20/02/26	197 664	0,02	290 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.104%, 15/11/34	228 897	0,03
265 000 EUR	Volvo Treasury AB, 0.010%, 18/05/26	246 347	0,03	900 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 3.250%, perpetual	869 022	0,10
300 000 EUR	Volvo Treasury AB, 2.000%, 19/08/27	289 704	0,03	600 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 3.625%, perpetual	561 678	0,07
200 000 EUR	Volvo Treasury AB, 3.625%, perpetual	203 442	0,02	400 000 EUR	Brambles Finance PLC, 4.250%, 22/03/31	421 804	0,05
Suède – Total		24 382 702	2,85	480 000 EUR	British Telecommunications PLC, 0.500%, 12/09/25	457 272	0,05
Suisse				690 000 EUR	British Telecommunications PLC, 1.750%, 10/03/26	669 265	0,08
500 000 EUR	Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 4.840%, perpetual	521 525	0,06				
Suisse – Total		521 525	0,06				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
200 000 EUR	British Telecommunications PLC, 3.750%, 13/05/31	205 614	0,02	300 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 6.364%, 16/11/32	322 815	0,04
400 000 EUR	British Telecommunications PLC, 3.375%, 30/08/32	400 032	0,05	900 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.856%, perpetual	954 144	0,11
200 000 EUR	BUPA Finance PLC, 5.000%, 12/10/30	214 852	0,03	200 000 EUR	Imperial Brands Finance PLC, 3.375%, 26/02/26	198 178	0,02
200 000 EUR	Cadent Finance PLC, 0.625%, 19/03/30	168 436	0,02	690 000 EUR	Imperial Brands Finance PLC, 2.125%, 12/02/27	665 298	0,08
100 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1.500%, 08/11/27	94 489	0,01	190 000 EUR	InterContinental Hotels Group PLC, 2.125%, 15/05/27	183 166	0,02
650 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1.750%, 26/05/28	617 142	0,07	480 000 EUR	Intermediate Capital Group PLC, 1.625%, 17/02/27	442 901	0,05
280 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 0.200%, 02/12/28	244 334	0,03	200 000 EUR	Intermediate Capital Group PLC, 2.500%, 28/01/30	176 126	0,02
350 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1.125%, 12/04/29	317 453	0,04	180 000 EUR	International Distributions Services PLC, 1.250%, 08/10/26	168 109	0,02
40 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 0.700%, 12/09/31	33 473	0,00	180 000 EUR	International Distributions Services PLC, 5.250%, 14/09/28	186 818	0,02
300 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 0.700%, 12/09/31	251 046	0,03	200 000 EUR	Investec Bank PLC, 1.250%, 11/08/26	187 576	0,02
300 000 EUR	Diageo Finance PLC, 2.375%, 20/05/26	292 836	0,03	300 000 EUR	Investec Bank PLC, 0.500%, 17/02/27	274 209	0,03
350 000 EUR	Diageo Finance PLC, 1.875%, 27/03/27	338 758	0,04	500 000 EUR	Linde PLC, 0.010%, perpetual	461 675	0,05
100 000 EUR	Diageo Finance PLC, 1.500%, 22/10/27	94 983	0,01	490 000 EUR	Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 2.375%, 09/04/26	481 249	0,06
330 000 EUR	Diageo Finance PLC, 2.500%, 27/03/32	316 388	0,04	400 000 EUR	Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 4.125%, perpetual	409 456	0,05
280 000 EUR	DS Smith PLC, 0.875%, 12/09/26	261 237	0,03	200 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 3.500%, 01/04/26	199 398	0,02
350 000 EUR	DS Smith PLC, 4.375%, 27/07/27	360 157	0,04	800 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 4.500%, 11/01/29	830 880	0,10
400 000 EUR	DS Smith PLC, 4.500%, 27/07/30	416 716	0,05	410 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 4.500%, 18/03/30	408 942	0,05
180 000 EUR	Experian Finance PLC, 1.375%, 25/06/26	172 141	0,02	800 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 3.125%, 24/08/30	778 632	0,09
299 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 4.000%, 16/06/25	301 909	0,04	450 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 4.750%, 21/09/31	475 452	0,06
490 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.250%, 21/05/26	471 434	0,06	110 000 EUR	London Stock Exchange Group PLC, 1.750%, 06/12/27	105 346	0,01
550 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.000%, 12/09/26	524 364	0,06	360 000 EUR	London Stock Exchange Group PLC, 1.750%, 19/09/29	336 578	0,04
100 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.375%, 12/09/29	92 650	0,01	180 000 EUR	Mobico Group PLC, 4.875%, 26/09/31	182 941	0,02
289 000 EUR	GSK Capital BV, 3.000%, 28/11/27	291 318	0,03	190 000 EUR	Mondi Finance PLC, 1.625%, 27/04/26	183 415	0,02
100 000 EUR	GSK Capital BV, 3.125%, 28/11/32	101 141	0,01	350 000 EUR	Motability Operations Group PLC, 0.875%, 14/03/25	339 682	0,04
300 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 0.309%, 13/11/26	282 663	0,03	150 000 EUR	Motability Operations Group PLC, 0.375%, 03/01/26	141 894	0,02
440 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 2.500%, 15/03/27	431 565	0,05	300 000 EUR	Motability Operations Group PLC, 0.125%, 20/07/28	263 985	0,03
700 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.019%, 15/06/27	691 418	0,08	100 000 EUR	National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3.530%, 20/09/28	101 567	0,01
500 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.752%, 10/03/28	518 580	0,06	100 000 EUR	National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3.949%, 20/09/32	102 862	0,01
460 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.125%, 07/06/28	452 272	0,05				
740 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 0.770%, 13/11/31	620 261	0,07				
500 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.787%, 10/03/32	528 645	0,06				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
300 000 EUR	National Grid Electricity Transmission PLC, 0.190%, 20/01/25	289 386	0,03	410 000 EUR	Omnicom Finance Holdings PLC, 1.400%, 08/07/31	367 196	0,04
400 000 EUR	National Grid Electricity Transmission PLC, 0.872%, 26/11/40	266 224	0,03	300 000 EUR	Ote PLC, 0.875%, 24/09/26	281 601	0,03
830 000 EUR	National Grid PLC, 2.179%, 30/06/26	806 951	0,10	350 000 EUR	Pearson Funding PLC, 1.375%, 06/05/25	338 044	0,04
100 000 EUR	National Grid PLC, 0.163%, 20/01/28	88 583	0,01	180 000 EUR	Phoenix Group Holdings PLC, 4.375%, 24/01/29	172 190	0,02
275 000 EUR	National Grid PLC, 0.250%, 01/09/28	240 133	0,03	230 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3.625%, 14/09/28	237 855	0,03
300 000 EUR	National Grid PLC, 3.875%, 16/01/29	308 382	0,04	270 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3.875%, 14/09/33	285 857	0,03
525 000 EUR	National Grid PLC, 0.553%, 18/09/29	451 327	0,05	300 000 EUR	Rentokil Initial Finance BV, 3.875%, 27/06/27	305 775	0,04
630 000 EUR	National Grid PLC, 2.949%, 30/03/30	613 544	0,07	180 000 EUR	Rentokil Initial PLC, 0.500%, 14/10/28	159 448	0,02
300 000 EUR	National Grid PLC, 4.275%, 16/01/35	310 482	0,04	100 000 EUR	Rentokil Initial PLC, 0.500%, 14/10/28	88 582	0,01
760 000 EUR	Nationwide Building Society, 1.250%, 03/03/25	739 655	0,09	400 000 EUR	Sage Group PLC, 3.820%, perpetual	411 392	0,05
340 000 EUR	Nationwide Building Society, 1.500%, 08/03/26	330 908	0,04	300 000 EUR	Santander UK Group Holdings PLC, 3.530%, 25/08/28	297 777	0,04
400 000 EUR	Nationwide Building Society, 4.500%, 01/11/26	412 576	0,05	205 000 EUR	Santander UK Group Holdings PLC, 0.603%, 13/09/29	176 341	0,02
300 000 EUR	Nationwide Building Society, 2.000%, 28/04/27	288 465	0,03	200 000 EUR	Santander UK PLC, 1.125%, 10/03/25	193 920	0,02
200 000 EUR	Nationwide Building Society, 0.250%, 14/09/28	174 550	0,02	50 000 EUR	Sky Ltd, 2.250%, 17/11/25	49 157	0,01
420 000 EUR	Nationwide Building Society, 3.250%, 05/09/29	419 290	0,05	100 000 EUR	Sky Ltd, 2.250%, 17/11/25	98 313	0,01
300 000 EUR	Natwest Group PLC, 0.780%, 26/02/30	258 345	0,03	380 000 EUR	Sky Ltd, 2.500%, 15/09/26	374 384	0,04
262 000 EUR	NatWest Group PLC, 4.699%, 14/03/28	269 598	0,03	600 000 EUR	Sky Ltd, 2.500%, 15/09/26	591 132	0,07
500 000 EUR	NatWest Group PLC, 4.067%, 06/09/28	509 160	0,06	620 000 EUR	Smiths Group PLC, 2.000%, 23/02/27	600 836	0,07
600 000 EUR	NatWest Group PLC, 4.771%, 16/02/29	623 946	0,07	480 000 EUR	SSE PLC, 1.250%, 16/04/25	466 018	0,06
300 000 EUR	NatWest Group PLC, 0.670%, 14/09/29	260 535	0,03	250 000 EUR	SSE PLC, 0.875%, 06/09/25	240 135	0,03
400 000 EUR	NatWest Group PLC, 1.043%, 14/09/32	353 376	0,04	568 000 EUR	SSE PLC, 2.875%, 01/08/29	561 792	0,07
400 000 EUR	NatWest Group PLC, 5.763%, 28/02/34	420 836	0,05	390 000 EUR	SSE PLC, 1.750%, 16/04/30	357 696	0,04
330 000 EUR	NatWest Markets PLC, 2.750%, 02/04/25	326 947	0,04	300 000 EUR	SSE PLC, 4.000%, 05/09/31	313 599	0,04
290 000 EUR	NatWest Markets PLC, 0.125%, 12/11/25	273 203	0,03	400 000 EUR	Standard Chartered PLC, 0.900%, 02/07/27	373 728	0,04
300 000 EUR	NatWest Markets PLC, 0.125%, 18/06/26	277 995	0,03	400 000 EUR	Standard Chartered PLC, 0.850%, 27/01/28	366 428	0,04
600 000 EUR	NatWest Markets PLC, 1.375%, 02/03/27	564 696	0,07	360 000 EUR	Standard Chartered PLC, 2.500%, 09/09/30	348 430	0,04
600 000 EUR	NatWest Markets PLC, 4.250%, 13/01/28	620 166	0,07	400 000 EUR	Standard Chartered PLC, 1.200%, 23/09/31	362 840	0,04
150 000 EUR	Omnicom Finance Holdings PLC, 0.800%, 08/07/27	138 590	0,02	700 000 EUR	Standard Chartered PLC, 4.874%, perpetual	732 536	0,09
				700 000 EUR	Swiss Re Finance Uk PLC, 2.714%, 04/06/52	620 571	0,07
				420 000 EUR	Tesco Corporate Treasury Services PLC, 0.875%, 29/05/26	397 816	0,05
				235 000 EUR	Tesco Corporate Treasury Services PLC, 0.375%, 27/07/29	199 682	0,02
				300 000 EUR	Tesco Corporate Treasury Services PLC, 4.250%, perpetual	311 721	0,04
				200 000 EUR	Thames Water Utilities Finance PLC, 4.000%, 18/04/27	193 564	0,02

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				États-Unis (suite)			
200 000 EUR	Thames Water Utilities Finance PLC, 0.875%, 31/01/28	170 796	0,02	200 000 EUR	American Tower Corp, 0.450%, 15/01/27	182 916	0,02
300 000 EUR	Thames Water Utilities Finance PLC, 4.375%, 18/01/31	283 125	0,03	200 000 EUR	American Tower Corp, 4.125%, 16/05/27	204 360	0,02
200 000 EUR	Thames Water Utilities Finance PLC, 1.250%, 31/01/32	150 438	0,02	205 000 EUR	American Tower Corp, 0.500%, 15/01/28	182 823	0,02
670 000 EUR	Unilever PLC, 1.500%, 11/06/39	543 584	0,06	300 000 EUR	American Tower Corp, 0.875%, 21/05/29	261 519	0,03
200 000 EUR	Virgin Money UK PLC, 4.625%, 29/10/28	199 522	0,02	190 000 EUR	American Tower Corp, 1.000%, 15/01/32	155 443	0,02
360 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.125%, 20/11/25	346 554	0,04	200 000 EUR	American Tower Corp, 4.625%, perpetual	210 706	0,02
380 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.200%, 25/08/26	372 799	0,04	190 000 EUR	Amgen Inc, 2.000%, 25/02/26	185 558	0,02
300 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.500%, 24/07/27	286 317	0,03	500 000 EUR	Apple Inc, 0.875%, 24/05/25	484 460	0,06
330 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.625%, 24/11/30	299 300	0,04	330 000 EUR	Apple Inc, 0.010%, 15/11/25	312 886	0,04
620 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.875%, 20/11/37	572 068	0,07	300 000 EUR	Apple Inc, 2.000%, 17/09/27	293 532	0,04
220 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.500%, 24/05/39	191 943	0,02	500 000 EUR	Apple Inc, 1.375%, 24/05/29	469 780	0,06
500 000 EUR	Westpac Securities NZ Ltd, 1.099%, 24/03/26	474 365	0,06	500 000 EUR	Apple Inc, 0.500%, 15/11/31	425 985	0,05
265 000 EUR	Westpac Securities NZ Ltd, 0.427%, 14/12/26	243 562	0,03	240 000 EUR	Archer-Daniels-Midland Co, 1.000%, 12/09/25	231 286	0,03
300 000 EUR	Westpac Securities NZ Ltd, 0.100%, 13/07/27	268 392	0,03	1 000 000 EUR	AT&T Inc, 3.500%, 17/12/25	1 002 270	0,12
250 000 EUR	WPP Finance 2016, 1.375%, 20/03/25	243 040	0,03	300 000 EUR	AT&T Inc, 1.800%, 05/09/26	289 602	0,03
205 000 EUR	Yorkshire Building Society 0.500%, 01/07/28	179 422	0,02	300 000 EUR	AT&T Inc, 2.350%, 05/09/29	287 493	0,03
350 000 EUR	Yorkshire Building Society 0.625%, perpetual	332 272	0,04	280 000 EUR	AT&T Inc, 2.600%, 17/12/29	269 954	0,03
Royaume-Uni – Total		60 721 181	7,11	390 000 EUR	AT&T Inc, 0.800%, 04/03/30	338 984	0,04
États-Unis				830 000 EUR	AT&T Inc, 3.550%, 17/12/32	832 399	0,10
150 000 EUR	AbbVie Inc, 0.750%, 18/11/27	138 390	0,02	400 000 EUR	AT&T Inc, 2.450%, 15/03/35	355 672	0,04
150 000 EUR	AbbVie Inc, 2.625%, 15/11/28	147 512	0,02	580 000 EUR	AT&T Inc, 3.150%, 04/09/36	540 183	0,06
250 000 EUR	AbbVie Inc, 2.125%, 17/11/28	240 915	0,03	100 000 EUR	AT&T Inc, 2.600%, 19/05/38	85 786	0,01
410 000 EUR	AbbVie Inc, 2.125%, 01/06/29	391 693	0,05	190 000 EUR	AT&T Inc, 1.800%, 14/09/39	144 717	0,02
250 000 EUR	AbbVie Inc, 1.250%, 18/11/31	218 270	0,03	300 000 EUR	AT&T Inc, 3.550%, perpetual	301 638	0,04
300 000 EUR	Air Products and Chemicals Inc, 1.000%, 12/02/25	292 584	0,03	800 000 EUR	AT&T Inc, 3.950%, perpetual	829 912	0,10
150 000 EUR	Air Products and Chemicals Inc, 0.500%, 05/05/28	135 486	0,02	400 000 EUR	AT&T Inc, 4.300%, perpetual	422 652	0,05
300 000 EUR	Air Products and Chemicals Inc, 4.000%, 03/03/35	316 512	0,04	200 000 EUR	Athene Global Funding, 1.125%, 02/09/25	190 778	0,02
480 000 EUR	Altria Group Inc, 2.200%, 15/06/27	462 293	0,05	200 000 EUR	Athene Global Funding, 0.832%, 08/01/27	184 740	0,02
710 000 EUR	Altria Group Inc, 3.125%, 15/06/31	644 687	0,08	200 000 EUR	Athene Global Funding, 0.625%, 12/01/28	177 962	0,02
300 000 EUR	American Honda Finance Corp, 3.750%, 25/10/27	307 743	0,04	300 000 EUR	Autoliv Inc, 4.250%, 15/03/28	307 698	0,04
405 000 EUR	American Honda Finance Corp, 0.300%, 07/07/28	358 546	0,04	200 000 EUR	Avery Dennison Corp, 1.250%, 03/03/25	194 054	0,02
370 000 EUR	American International Group Inc, 1.875%, 21/06/27	354 164	0,04	790 000 EUR	Bank of America Corp, 0.808%, 09/05/26	759 237	0,09
650 000 EUR	American Tower Corp, 1.950%, 22/05/26	626 925	0,08	1 050 000 EUR	Bank of America Corp, 1.949%, 27/10/26	1 019 434	0,12
				510 000 EUR	Bank of America Corp, 1.776%, 04/05/27	489 972	0,06
				1 040 000 EUR	Bank of America Corp, 1.662%, 25/04/28	982 852	0,12
				485 000 EUR	Bank of America Corp, 4.134%, 12/06/28	500 166	0,06
				400 000 EUR	Bank of America Corp, 0.580%, 08/08/29	351 136	0,04
				390 000 EUR	Bank of America Corp, 1.381%, 09/05/30	348 699	0,04

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
500 000 EUR	Bank of America Corp, 0.654%, 26/10/31	409 520	0,05	500 000 EUR	Bristol-Myers Squibb Co, 1.000%, 15/05/25	485 250	0,06
850 000 EUR	Bank of America Corp, 2.824%, 27/04/33	797 521	0,09	200 000 EUR	Bristol-Myers Squibb Co, 1.750%, 15/05/35	176 736	0,02
270 000 EUR	Baxter International Inc, 1.300%, 15/05/29	242 341	0,03	180 000 EUR	Brown-Forman Corp, 1.200%, 07/07/26	171 837	0,02
200 000 EUR	Becton Dickinson & Co, 0.034%, 13/08/25	189 394	0,02	100 000 EUR	Capital One Financial Corp, 1.650%, 12/06/29	88 022	0,01
550 000 EUR	Becton Dickinson & Co, 1.900%, 15/12/26	531 399	0,06	255 000 EUR	Cargill Inc, 3.875%, perpetual	264 593	0,03
300 000 EUR	Berkshire Hathaway Finance Corp, 1.500%, 18/03/30	272 058	0,03	300 000 EUR	Carrier Global Corp, 4.375%, 29/05/25	302 601	0,04
200 000 EUR	Berkshire Hathaway Inc, 0.010%, 12/03/25	192 416	0,02	600 000 EUR	Carrier Global Corp, 4.125%, 29/05/28	618 312	0,07
370 000 EUR	Berkshire Hathaway Inc, 1.125%, 16/03/27	348 755	0,04	300 000 EUR	Carrier Global Corp, 4.500%, 29/11/32	320 970	0,04
220 000 EUR	Berkshire Hathaway Inc, 2.150%, 15/03/28	213 919	0,03	190 000 EUR	Celanese US Holdings LLC, 1.250%, 11/02/25	184 500	0,02
660 000 EUR	Berkshire Hathaway Inc, 1.625%, 16/03/35	557 456	0,07	300 000 EUR	Celanese US Holdings LLC, 4.777%, 19/07/26	305 169	0,04
100 000 EUR	Berry Global Inc, 1.500%, 15/01/27	93 581	0,01	280 000 EUR	Celanese US Holdings LLC, 2.125%, 01/03/27	267 126	0,03
250 000 EUR	BlackRock Inc, 1.250%, 06/05/25	243 857	0,03	100 000 EUR	Celanese US Holdings LLC, 0.625%, 10/09/28	86 000	0,01
450 000 EUR	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 2.000%, 19/05/25	440 698	0,05	370 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 1.550%, 15/03/28	349 136	0,04
480 000 EUR	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 1.000%, 05/10/26	449 434	0,05	225 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 0.875%, 15/12/29	199 262	0,02
80 000 EUR	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 1.500%, 10/04/29	72 401	0,01	550 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 1.400%, 15/06/31	484 396	0,06
200 000 EUR	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 3.500%, 01/06/34	193 434	0,02	500 000 EUR	Citigroup Inc, 1.750%, 28/01/25	489 180	0,06
400 000 EUR	Blackstone Private Credit Fund, 1.750%, 30/11/26	357 380	0,04	630 000 EUR	Citigroup Inc, 1.250%, 06/07/26	606 621	0,07
550 000 EUR	BMW US Capital LLC, 1.000%, 20/04/27	518 831	0,06	580 000 EUR	Citigroup Inc, 1.500%, 24/07/26	560 002	0,07
245 000 EUR	Booking Holdings Inc, 0.100%, 08/03/25	235 445	0,03	300 000 EUR	Citigroup Inc, 2.125%, 10/09/26	288 834	0,03
150 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.000%, 15/11/26	154 100	0,02	300 000 EUR	Citigroup Inc, 1.625%, 21/03/28	281 406	0,03
380 000 EUR	Booking Holdings Inc, 1.800%, 03/03/27	365 834	0,04	300 000 EUR	Citigroup Inc, 3.713%, 22/09/28	304 389	0,04
215 000 EUR	Booking Holdings Inc, 0.500%, 08/03/28	194 941	0,02	400 000 EUR	Citigroup Inc, 1.500%, 26/10/28	368 360	0,04
184 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.250%, 15/05/29	194 720	0,02	1 000 000 EUR	Citigroup Inc, 4.112%, 22/09/33	1 031 570	0,12
467 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.500%, 15/11/31	508 344	0,06	1 000 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.125%, 09/03/27	943 520	0,11
700 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.125%, 12/05/33	746 991	0,09	200 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.125%, 09/03/29	174 224	0,02
100 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.750%, 15/11/34	112 755	0,01	300 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.125%, 15/03/29	261 591	0,03
200 000 EUR	Booking Holdings Inc, 3.625%, perpetual	205 496	0,02	100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.400%, 06/05/30	85 837	0,01
500 000 EUR	BorgWarner Inc, 1.000%, 19/05/31	411 460	0,05	300 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.500%, 09/03/33	241 299	0,03
300 000 EUR	Boston Scientific Corp, 0.625%, 01/12/27	274 146	0,03	300 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.375%, 15/03/33	238 734	0,03
				460 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.625%, 09/03/35	397 504	0,05
				105 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.950%, 06/05/36	81 747	0,01
				150 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.100%, 02/09/36	118 404	0,01
				300 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.800%, 15/03/40	208 953	0,02
				700 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.000%, 09/03/41	500 752	0,06
				350 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1.875%, 18/03/30	324 488	0,04
				142 000 EUR	Colgate-Palmolive Co, 0.500%, 06/03/26	135 072	0,02
				390 000 EUR	Colgate-Palmolive Co, 1.375%, 06/03/34	341 133	0,04
				400 000 EUR	Comcast Corp, 0.010%, 14/09/26	368 940	0,04

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
300 000 EUR	Comcast Corp, 0.250%, 20/05/27	275 031	0,03	500 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 3.250%, 15/09/25	493 770	0,06
135 000 EUR	Comcast Corp, 0.250%, 14/09/29	116 716	0,01	500 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 2.386%, 17/02/26	485 750	0,06
400 000 EUR	Comcast Corp, 0.750%, 20/02/32	336 344	0,04	100 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 5.125%, 20/02/29	104 698	0,01
300 000 EUR	Corning Inc, 3.875%, perpetual	303 291	0,04	510 000 EUR	General Electric Co, 0.875%, 17/05/25	492 578	0,06
200 000 EUR	Corning Inc, 4.125%, perpetual	209 266	0,02	400 000 EUR	General Electric Co, 1.500%, 17/05/29	370 296	0,04
300 000 EUR	Danaher Corp, 2.500%, 30/03/30	291 066	0,03	300 000 EUR	General Electric Co, 4.125%, 19/09/35	320 997	0,04
290 000 EUR	Digital Euro Finco LLC, 2.500%, 16/01/26	282 356	0,03	180 000 EUR	General Mills Inc, 0.125%, 15/11/25	169 988	0,02
410 000 EUR	Digital Euro Finco LLC, 1.125%, 09/04/28	371 050	0,04	200 000 EUR	General Mills Inc, 0.450%, 15/01/26	188 692	0,02
370 000 EUR	Dover Corp, 1.250%, 09/11/26	352 466	0,04	410 000 EUR	General Mills Inc, 1.500%, 27/04/27	387 696	0,05
180 000 EUR	Dover Corp, 0.750%, 04/11/27	164 768	0,02	400 000 EUR	General Mills Inc, 3.907%, 13/04/29	412 704	0,05
250 000 EUR	Dow Chemical Co, 0.500%, 15/03/27	229 365	0,03	280 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 0.850%, 26/02/26	265 773	0,03
410 000 EUR	Dow Chemical Co, 1.875%, 15/03/40	309 829	0,04	325 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 0.600%, 20/05/27	297 004	0,03
410 000 EUR	DXC Technology Co, 1.750%, 15/01/26	395 798	0,05	200 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 0.650%, 07/09/28	175 928	0,02
110 000 EUR	Eastman Chemical Co, 1.875%, 23/11/26	105 416	0,01	400 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 4.300%, 15/02/29	412 100	0,05
270 000 EUR	Ecolab Inc, 2.625%, 08/07/25	266 935	0,03	200 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 4.500%, perpetual	207 262	0,02
500 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.625%, 02/06/26	485 800	0,06	660 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 3.375%, 27/03/25	658 654	0,08
220 000 EUR	Eli Lilly & Co, 2.125%, 03/06/30	213 354	0,02	290 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 2.875%, 03/06/26	287 866	0,03
180 000 EUR	Eli Lilly & Co, 0.625%, 01/11/31	154 289	0,02	595 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.625%, 27/07/26	571 944	0,07
200 000 EUR	Eli Lilly & Co, 0.500%, 14/09/33	162 868	0,02	390 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.250%, 26/01/28	345 364	0,04
180 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.700%, 01/11/49	135 918	0,02	200 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.250%, 26/01/28	177 110	0,02
500 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.125%, 14/09/51	325 400	0,04	225 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 2.000%, 22/03/28	214 726	0,03
180 000 EUR	Emerson Electric Co, 1.250%, 15/10/25	174 085	0,02	440 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 2.000%, 01/11/28	415 976	0,05
170 000 EUR	Emerson Electric Co, 2.000%, 15/10/29	161 590	0,02	300 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.250%, 07/02/29	268 431	0,03
100 000 EUR	Equinix Inc, 0.250%, 15/03/27	91 055	0,01	405 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.875%, 09/05/29	352 111	0,04
200 000 EUR	Equinix Inc, 1.000%, 15/03/33	161 718	0,02	560 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 4.000%, 21/09/29	577 864	0,07
200 000 EUR	Equitable Financial Life Global Funding, 0.600%, 16/06/28	177 840	0,02	40 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.875%, 21/01/30	34 419	0,00
200 000 EUR	Euronet Worldwide Inc, 1.375%, 22/05/26	187 422	0,02	400 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.875%, 21/01/30	344 192	0,04
590 000 EUR	Exxon Mobil Corp, 0.524%, 26/06/28	534 487	0,06	560 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 3.000%, 12/02/31	551 029	0,06
290 000 EUR	Exxon Mobil Corp, 0.835%, 26/06/32	240 140	0,03	400 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.750%, 23/03/32	319 608	0,04
350 000 EUR	Fedex Corp, 1.300%, 05/08/31	309 092	0,04				
340 000 EUR	FedEx Corp, 1.625%, 11/01/27	325 700	0,04				
385 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 0.625%, 03/12/25	365 892	0,04				
390 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 2.000%, 21/05/30	361 717	0,04				
225 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 2.950%, 21/05/39	197 305	0,02				
180 000 EUR	Fiserv Inc, 1.125%, 01/07/27	168 808	0,02				
210 000 EUR	Fiserv Inc, 1.625%, 01/07/30	189 823	0,02				
400 000 EUR	Fiserv Inc, 4.500%, perpetual	424 452	0,05				
500 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 1.355%, 07/02/25	484 035	0,06				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
500 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.000%, 18/03/33	397 170	0,05	1 110 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.090%, 11/03/27	1 054 522	0,12
300 000 EUR	Harley-Davidson Financial Services Inc, 5.125%, 05/04/26	309 489	0,04	700 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 0.389%, 24/02/28	637 728	0,07
200 000 EUR	IHG Finance LLC, 4.375%, 28/11/29	207 328	0,02	960 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.638%, 18/05/28	906 826	0,11
100 000 EUR	Illinois Tool Works Inc, 0.625%, 05/12/27	91 998	0,01	910 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.812%, 12/06/29	851 096	0,10
520 000 EUR	Illinois Tool Works Inc, 2.125%, 22/05/30	498 238	0,06	735 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.963%, 23/03/30	684 623	0,08
350 000 EUR	Illinois Tool Works Inc, 1.000%, 05/06/31	308 028	0,04	500 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.047%, 04/11/32	418 425	0,05
350 000 EUR	Illinois Tool Works Inc, 3.000%, 19/05/34	347 560	0,04	500 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 0.597%, 17/02/33	402 060	0,05
330 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.875%, 31/01/25	320 466	0,04	350 000 EUR	Kellanova, 1.250%, 10/03/25	341 159	0,04
320 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.950%, 23/05/25	309 405	0,04	25 000 EUR	Kellanova, 0.500%, 20/05/29	21 654	0,00
350 000 EUR	International Business Machines Corp, 2.875%, 07/11/25	347 875	0,04	320 000 EUR	Kinder Morgan Inc, 2.250%, 16/03/27	307 728	0,03
350 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.250%, 29/01/27	332 517	0,04	500 000 EUR	KKR Group Finance Co V LLC, 1.625%, 22/05/29	450 450	0,05
300 000 EUR	International Business Machines Corp, 3.375%, 06/02/27	303 606	0,04	300 000 EUR	Liberty Mutual Group Inc, 4.625%, 02/12/30	314 325	0,04
410 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.300%, 11/02/28	369 353	0,04	159 000 EUR	Linde Inc/CT, 1.625%, 01/12/25	154 546	0,02
750 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.750%, 07/03/28	718 950	0,08	320 000 EUR	ManpowerGroup Inc, 1.750%, 22/06/26	309 546	0,04
330 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.500%, 23/05/29	307 250	0,04	100 000 EUR	ManpowerGroup Inc, 3.500%, perpetual	100 123	0,01
400 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.875%, 09/02/30	353 848	0,04	190 000 EUR	Marsh & McLennan Cos Inc, 1.349%, 21/09/26	181 929	0,02
370 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.750%, 31/01/31	339 471	0,04	190 000 EUR	Marsh & McLennan Cos Inc, 1.979%, 21/03/30	179 031	0,02
300 000 EUR	International Business Machines Corp, 3.625%, 06/02/31	309 360	0,04	290 000 EUR	Mastercard Inc, 2.100%, 01/12/27	282 248	0,03
300 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.250%, 09/02/34	250 926	0,03	145 000 EUR	Mastercard Inc, 1.000%, 22/02/29	133 191	0,02
300 000 EUR	International Business Machines Corp, 3.750%, 06/02/35	313 008	0,04	600 000 EUR	McDonald's Corp, 0.900%, 15/06/26	570 768	0,07
300 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.200%, 11/02/40	217 905	0,03	600 000 EUR	McDonald's Corp, 3.625%, 28/11/27	612 786	0,07
300 000 EUR	International Business Machines Corp, 4.000%, 06/02/43	311 934	0,04	200 000 EUR	McDonald's Corp, 2.375%, 31/05/29	193 906	0,02
300 000 EUR	Johnson & Johnson, 1.150%, 20/11/28	282 303	0,03	200 000 EUR	McDonald's Corp, 2.625%, 11/06/29	196 204	0,02
600 000 EUR	Johnson & Johnson, 1.650%, 20/05/35	538 494	0,06	500 000 EUR	McDonald's Corp, 1.500%, 28/11/29	457 250	0,05
260 000 EUR	Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA, 3.000%, 15/09/28	258 937	0,03	300 000 EUR	McDonald's Corp, 4.000%, 07/03/30	314 148	0,04
300 000 EUR	Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA, 3.000%, 15/09/28	298 773	0,03	100 000 EUR	McDonald's Corp, 3.875%, 20/02/31	103 878	0,01
760 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 3.000%, 19/02/26	754 748	0,09	100 000 EUR	McDonald's Corp, 1.600%, 15/03/31	89 911	0,01
470 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.500%, 29/10/26	450 321	0,05	140 000 EUR	McDonald's Corp, 3.000%, 31/05/34	135 815	0,02
				300 000 EUR	McDonald's Corp, 4.250%, 07/03/35	322 278	0,04
				300 000 EUR	McDonald's Corp, 4.125%, 28/11/35	316 176	0,04
				140 000 EUR	McKesson Corp, 1.500%, 17/11/25	135 621	0,02

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
460 000 EUR	McKesson Corp, 1.625%, 30/10/26	442 939	0,05	300 000 EUR	Nestle Holdings Inc, 0.875%, 18/07/25	289 362	0,03
290 000 EUR	Merck & Co Inc, 1.875%, 15/10/26	282 167	0,03	500 000 EUR	Netflix Inc, 3.625%, 15/05/27	505 915	0,06
80 000 EUR	Merck & Co Inc, 2.500%, 15/10/34	77 461	0,01	500 000 EUR	Netflix Inc, 3.875%, 15/11/29	516 535	0,06
150 000 EUR	Merck & Co Inc, 1.375%, 02/11/36	124 325	0,01	500 000 EUR	Netflix Inc, 3.625%, 15/06/30	509 545	0,06
289 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 4.000%, 05/04/28	298 294	0,03	710 000 EUR	New York Life Global Funding, 0.250%, 23/01/27	657 048	0,08
700 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.500%, 25/05/29	609 028	0,07	200 000 EUR	New York Life Global Funding, 3.625%, 09/01/30	205 836	0,02
400 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 3.750%, 07/12/31	411 780	0,05	670 000 EUR	Parker-Hannifin Corp, 1.125%, 01/03/25	649 719	0,08
510 000 EUR	Microsoft Corp, 3.125%, 06/12/28	525 320	0,06	100 000 EUR	Pepsico Inc, 0.750%, 18/03/27	93 896	0,01
100 000 EUR	Microsoft Corp, 2.625%, 02/05/33	100 931	0,01	200 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.500%, 06/05/28	181 998	0,02
300 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 0.625%, 13/06/25	287 454	0,03	250 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.875%, 18/07/28	229 980	0,03
100 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 1.250%, 13/06/28	92 369	0,01	150 000 EUR	PepsiCo Inc, 1.125%, 18/03/31	133 671	0,02
200 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 1.750%, 13/06/31	180 992	0,02	550 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.400%, 09/10/32	444 438	0,05
300 000 EUR	Mondelez International Inc, 1.625%, 08/03/27	286 590	0,03	335 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.750%, 14/10/33	273 883	0,03
700 000 EUR	Mondelez International Inc, 0.250%, 17/03/28	625 919	0,07	310 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.875%, 16/10/39	224 700	0,03
324 000 EUR	Mondelez International Inc, 2.375%, 06/03/35	292 809	0,03	350 000 EUR	PepsiCo Inc, 1.050%, 09/10/50	227 773	0,03
500 000 EUR	Mondelez International Inc, 1.375%, 17/03/41	366 375	0,04	100 000 EUR	Philip Morris International Inc, 2.750%, 19/03/25	99 050	0,01
270 000 EUR	Moody's Corp, 1.750%, 09/03/27	260 134	0,03	310 000 EUR	Philip Morris International Inc, 2.875%, 03/03/26	307 241	0,04
390 000 EUR	Moody's Corp, 0.950%, 25/02/30	346 219	0,04	200 000 EUR	Philip Morris International Inc, 0.125%, 03/08/26	184 790	0,02
500 000 EUR	Morgan Stanley, 1.750%, 30/01/25	489 790	0,06	150 000 EUR	Philip Morris International Inc, 2.875%, 14/05/29	146 124	0,02
500 000 EUR	Morgan Stanley, 2.103%, 08/05/26	488 640	0,06	220 000 EUR	Philip Morris International Inc, 0.800%, 01/08/31	179 406	0,02
370 000 EUR	Morgan Stanley, 1.342%, 23/10/26	355 100	0,04	210 000 EUR	Philip Morris International Inc, 3.125%, 03/06/33	203 368	0,02
300 000 EUR	Morgan Stanley, 1.375%, 27/10/26	284 961	0,03	350 000 EUR	Philip Morris International Inc, 2.000%, 09/05/36	274 354	0,03
615 000 EUR	Morgan Stanley, 1.875%, 27/04/27	586 815	0,07	150 000 EUR	Philip Morris International Inc, 1.450%, 01/08/39	98 333	0,01
600 000 EUR	Morgan Stanley, 0.406%, 29/10/27	550 956	0,06	190 000 EUR	Philip Morris International INC, 2.750%, 19/03/25	188 195	0,02
300 000 EUR	Morgan Stanley, 4.813%, 25/10/28	313 962	0,04	310 000 EUR	Philip Morris International INC, 1.875%, 06/11/37	232 267	0,03
1 100 000 EUR	Morgan Stanley, 4.656%, 02/03/29	1 142 086	0,13	50 000 EUR	PPG Industries Inc, 0.875%, 03/11/25	47 778	0,01
600 000 EUR	Morgan Stanley, 0.495%, 26/10/29	517 992	0,06	700 000 EUR	PPG Industries Inc, 2.750%, 01/06/29	683 858	0,08
600 000 EUR	Morgan Stanley, 0.497%, 07/02/31	496 908	0,06	800 000 EUR	Procter & Gamble Co, 3.250%, 02/08/26	808 104	0,09
500 000 EUR	Morgan Stanley, 2.950%, 07/05/32	473 210	0,06	220 000 EUR	Procter & Gamble Co, 4.875%, 11/05/27	234 307	0,03
600 000 EUR	Morgan Stanley, 1.102%, 29/04/33	487 062	0,06	490 000 EUR	Procter & Gamble Co, 1.200%, 30/10/28	457 518	0,05
700 000 EUR	Morgan Stanley, 5.148%, 25/01/34	768 824	0,09	100 000 EUR	Procter & Gamble Co, 0.350%, 05/05/30	86 133	0,01
550 000 EUR	Mylan Inc, 2.125%, 23/05/25	536 767	0,06	300 000 EUR	Procter & Gamble Co, 3.250%, 02/08/31	309 462	0,04
150 000 EUR	Nasdaq Inc, 1.750%, 28/03/29	139 196	0,02	300 000 EUR	Procter & Gamble Co, 1.875%, 30/10/38	263 355	0,03
165 000 EUR	Nasdaq Inc, 0.875%, 13/02/30	143 232	0,02				
300 000 EUR	Nasdaq Inc, 4.500%, 15/02/32	321 144	0,04				
190 000 EUR	Nasdaq Inc, 0.900%, 30/07/33	150 596	0,02				
200 000 EUR	National Grid North America Inc, 0.410%, 20/01/26	188 642	0,02				
180 000 EUR	National Grid North America Inc, 4.151%, 12/09/27	184 873	0,02				
100 000 EUR	National Grid North America Inc, 1.054%, 20/01/31	84 492	0,01				
180 000 EUR	National Grid North America Inc, 4.668%, 12/09/33	192 204	0,02				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
200 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 0.375%, 06/02/28	178 302	0,02	400 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 2.875%, 24/07/37	378 656	0,04
100 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.875%, 05/01/29	93 021	0,01	540 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.500%, 01/10/39	411 836	0,05
750 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.000%, 08/02/29	561 374	0,07	300 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.875%, 01/10/49	214 473	0,03
100 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 3.875%, 31/01/30	101 746	0,01	340 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 0.250%, 16/07/26	317 254	0,04
490 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 0.625%, 10/09/31	400 222	0,05	185 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 0.125%, 05/11/27	166 006	0,02
300 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.500%, 08/02/34	244 731	0,03	657 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 4.050%, 13/09/29	689 292	0,08
500 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 4.250%, 31/01/43	504 045	0,06	300 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 3.850%, 24/07/30	311 718	0,04
385 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 4.625%, perpetual	410 826	0,05	500 000 EUR	Unilever Capital Corp, 3.300%, 06/06/29	511 355	0,06
200 000 EUR	Public Storage Operating Co, 0.500%, 09/09/30	165 282	0,02	200 000 EUR	Unilever Capital Corp, 3.400%, 06/06/33	206 110	0,02
600 000 EUR	Public Storage Operating Co, 0.875%, 24/01/32	496 074	0,06	100 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.625%, 15/11/25	97 343	0,01
300 000 EUR	Realty Income Corp, 4.875%, 06/07/30	317 736	0,04	410 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.000%, 15/11/28	377 581	0,04
300 000 EUR	Realty Income Corp, 5.125%, 06/07/34	331 179	0,04	150 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.500%, 15/11/32	131 706	0,02
650 000 EUR	RELX Capital Inc, 1.300%, 12/05/25	631 566	0,08	180 000 EUR	Veralto Corp, 4.150%, 19/09/31	187 146	0,02
100 000 EUR	Revvity Inc, 1.875%, 19/07/26	96 335	0,01	750 000 EUR	Verizon Communications Inc, 3.250%, 17/02/26	752 520	0,09
200 000 EUR	Southern Power Co, 1.850%, 20/06/26	193 386	0,02	380 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.375%, 27/10/26	363 561	0,04
760 000 EUR	Stryker Corp, 2.125%, 30/11/27	735 520	0,09	570 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.375%, 02/11/28	528 145	0,06
400 000 EUR	Stryker Corp, 3.375%, 11/12/28	406 112	0,05	400 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.375%, 22/03/29	347 720	0,04
190 000 EUR	Stryker Corp, 0.750%, 01/03/29	168 952	0,02	550 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.875%, 26/10/29	513 133	0,06
190 000 EUR	Stryker Corp, 2.625%, 30/11/30	183 905	0,02	540 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.250%, 08/04/30	481 005	0,06
250 000 EUR	Stryker Corp, 2.625%, 30/11/30	211 412	0,02	700 000 EUR	Verizon Communications Inc, 4.250%, 31/10/30	742 042	0,09
200 000 EUR	Tapestry Inc, 5.375%, 27/11/27	204 076	0,02	350 000 EUR	Verizon Communications Inc, 2.625%, 01/12/31	334 344	0,04
100 000 EUR	Tapestry Inc, 5.375%, 27/11/27	103 587	0,01	700 000 EUR	Verizon Communications Inc, 4.750%, 31/10/34	775 404	0,09
600 000 EUR	Tapestry Inc, 5.875%, 27/11/31	630 570	0,07	490 000 EUR	Verizon Communications Inc, 2.875%, 15/01/38	452 476	0,05
100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 0.125%, 01/03/25	96 163	0,01	150 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.500%, 19/09/39	112 325	0,01
200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 3.200%, 21/01/26	200 434	0,02	280 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.850%, 18/05/40	219 495	0,03
220 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.400%, 23/01/26	212 282	0,02	400 000 EUR	VF Corp, 4.125%, 07/03/26	395 704	0,05
190 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.450%, 16/03/27	181 543	0,02	200 000 EUR	VF Corp, 4.250%, 07/03/29	192 026	0,02
390 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.750%, 15/04/27	376 147	0,04	500 000 EUR	Visa Inc, 1.500%, 15/06/26	483 140	0,06
100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 0.500%, 01/03/28	90 907	0,01	300 000 EUR	Visa Inc, 2.000%, 15/06/29	288 465	0,03
480 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.950%, 24/07/29	455 520	0,05	200 000 EUR	Visa Inc, 2.375%, 15/06/34	191 066	0,02
250 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 0.875%, 01/10/31	213 230	0,02	690 000 EUR	Westlake Corp, 1.625%, 17/07/29	619 337	0,07
190 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 2.375%, 15/04/32	180 139	0,02	200 000 EUR	Worley US Finance Sub Ltd, 0.875%, 09/06/26	186 794	0,02
260 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 3.650%, 21/11/34	270 629	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,62 % (suite)			
États-Unis (suite)			
370 000 EUR	Zimmer Biomet Holdings Inc, 2.425%, 13/12/26	362 900	0,04
190 000 EUR	Zimmer Biomet Holdings Inc, 1.164%, 15/11/27	176 083	0,02
États-Unis – Total		129 227 904	15,13
Total des obligations d'entreprise		842 596 381	98,62
Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
		842 596 381	98,62
TOTAL DES INVESTISSEMENTS		842 596 381	98,62
Autres actifs/(passifs) nets		11 815 623	1,38
TOTAL DES ACTIFS NETS		854 412 004	100,00

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 %				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Australie				Autriche			
200 000 EUR	Aurizon Network Pty Ltd, 3.125%, 01/06/26	197 993	0,06	100 000 EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 4.125%, 18/01/27	101 334	0,03
100 000 EUR	Ausgrid Finance Pty Ltd, 1.250%, 30/07/25	96 405	0,03	100 000 EUR	CA Immobilien Anlagen AG, 0.875%, 05/02/27	88 917	0,03
400 000 EUR	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 0.625%, 25/08/30	336 909	0,11	200 000 EUR	Erste Group Bank AG, 1.500%, 07/04/26	192 300	0,06
300 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0.750%, 29/09/26	281 496	0,09	300 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.875%, 13/05/27	272 575	0,09
100 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0.669%, 05/05/31	91 621	0,03	300 000 EUR	Erste Group Bank AG, 1.000%, 10/06/30	282 920	0,09
200 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 5.101%, 03/02/33	205 468	0,07	400 000 EUR	Erste Group Bank AG, 4.000%, 16/01/31	413 577	0,14
100 000 EUR	Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd, 4.375%, perpetual	105 690	0,04	100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 1.625%, 08/09/31	93 266	0,03
200 000 EUR	Commonwealth Bank of Australia, 1.125%, 18/01/28	187 296	0,06	100 000 EUR	HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG, 0.125%, 30/06/26	91 263	0,03
200 000 EUR	Goodman Australia Finance Pty Ltd, 1.375%, 27/09/25	193 204	0,06	100 000 EUR	Mondi Finance Europe GmbH, 2.375%, 01/04/28	98 491	0,03
100 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 4.747%, 23/01/30	105 135	0,04	200 000 EUR	OMV AG, 0.010%, 03/07/25	190 353	0,06
200 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.950%, 21/05/31	165 738	0,05	400 000 EUR	OMV AG, 1.000%, 14/12/26	380 120	0,12
200 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 2.125%, 24/05/28	193 000	0,06	100 000 EUR	OMV AG, 2.000%, 09/04/28	96 806	0,03
100 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 1.375%, 30/08/28	92 417	0,03	100 000 EUR	OMV AG, 1.875%, 04/12/28	95 157	0,03
100 000 EUR	NBN Co Ltd, 4.125%, 15/03/29	104 164	0,03	100 000 EUR	OMV AG, 6.250%, perpetual	103 373	0,03
100 000 EUR	NBN Co Ltd, 4.375%, perpetual	107 050	0,04	200 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 4.125%, 08/09/25	200 911	0,07
100 000 EUR	Optus Finance Pty Ltd, 1.000%, 20/06/29	87 538	0,03	300 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 5.750%, 27/01/28	320 418	0,10
300 000 EUR	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2, 1.750%, 11/04/28	273 113	0,09	400 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 6.000%, 15/09/28	417 092	0,14
200 000 EUR	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd, 4.375%, 03/05/33	210 306	0,07	300 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 2.875%, 18/06/32	268 875	0,09
200 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.125%, 14/04/26	191 620	0,06	200 000 EUR	Telekom Finanzmanagement GmbH, 1.500%, 07/12/26	192 439	0,06
100 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.375%, 26/03/29	92 331	0,03	Autriche – Total		3 900 187	1,26
100 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 2.000%, 28/08/25	97 633	0,03	Belgique			
100 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 1.750%, 29/03/28	94 124	0,03	200 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.700%, 31/03/26	198 023	0,06
200 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 3.000%, 08/04/30	195 430	0,06	200 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.125%, 01/07/27	188 638	0,06
100 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 4.225%, 26/04/33	105 086	0,03	300 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.125%, 02/12/27	291 911	0,10
100 000 EUR	Vicinity Centres Trust, 1.125%, 07/11/29	84 654	0,03	500 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.000%, 17/03/28	485 410	0,16
Australie – Total		3 895 421	1,26	300 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.650%, 28/03/31	274 841	0,09
				600 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.875%, 02/04/32	593 868	0,19
				300 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.750%, 17/03/36	285 795	0,09
				400 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3.700%, 02/04/40	407 975	0,13
				200 000 EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.000%, 29/01/27	182 333	0,06

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Belgique (suite)				Belgique (suite)			
100 000 EUR	Argenta Spaarbank NV, 5.375%, 29/11/27	103 316	0,03	200 000 EUR	Proximus SADP, 0.750%, 17/11/36	144 604	0,05
100 000 EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.375%, 08/02/29	88 721	0,03	300 000 EUR	VGP NV, 2.250%, 17/01/30	235 566	0,08
200 000 EUR	Belfius Bank SA, 0.375%, 13/02/26	187 055	0,06	Belgique – Total			
200 000 EUR	Belfius Bank SA, 0.010%, 28/08/26	183 136	0,06	7 995 766			
100 000 EUR	Belfius Bank SA, 0.375%, 08/06/27	90 359	0,03	2,58			
300 000 EUR	Belfius Bank SA, 0.125%, 08/02/28	264 613	0,09	Canada			
100 000 EUR	Belfius Bank SA, 3.875%, 12/06/28	102 350	0,03	200 000 EUR	Alimentation Couche-Tard Inc, 1.875%, 06/05/26	192 836	0,06
200 000 EUR	Belfius Bank SA, 4.125%, 12/09/29	206 820	0,07	200 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 0.250%, 01/11/28	173 511	0,06
100 000 EUR	Belfius Bank SA, 5.250%, 19/04/33	102 286	0,03	100 000 EUR	Magna International Inc, 1.500%, 25/09/27	95 187	0,03
100 000 EUR	Crelan SA, 5.750%, 26/01/28	104 593	0,03	200 000 EUR	Magna International Inc, 4.375%, 17/03/32	213 034	0,07
100 000 EUR	Crelan SA, 6.000%, 28/02/30	105 722	0,04	167 000 EUR	Royal Bank of Canada, 4.125%, 05/07/28	172 277	0,06
200 000 EUR	Elia Transmission Belgium SA, 1.375%, 14/01/26	192 187	0,06	200 000 EUR	Royal Bank of Canada, 2.125%, 26/04/29	188 315	0,06
100 000 EUR	Elia Transmission Belgium SA, 0.875%, 28/04/30	87 192	0,03	100 000 EUR	Royal Bank of Canada, 4.375%, 02/10/30	105 061	0,03
100 000 EUR	Elia Transmission Belgium SA, 3.625%, 18/01/33	103 092	0,03	300 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 0.500%, 18/01/27	277 647	0,09
200 000 EUR	FLUVIUS System Operator CVBA, 0.250%, 14/06/28	176 822	0,06	200 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 2.551%, 03/08/27	195 600	0,06
100 000 EUR	FLUVIUS System Operator CVBA, 3.875%, 18/03/31	103 551	0,03	200 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 3.129%, 03/08/32	195 448	0,06
100 000 EUR	FLUVIUS System Operator CVBA, 0.625%, 24/11/31	81 628	0,03	Canada – Total			
100 000 EUR	FLUVIUS System Operator CVBA, 4.000%, 06/07/32	104 000	0,03	1 808 916			
100 000 EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 1.875%, 19/06/25	97 728	0,03	0,58			
200 000 EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 4.000%, perpetual	210 026	0,07	Îles Caïmans			
100 000 EUR	KBC Group NV, 0.625%, 10/04/25	96 514	0,03	200 000 EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 2.000%, 13/04/30	181 009	0,06
200 000 EUR	KBC Group NV, 1.500%, 29/03/26	194 454	0,06	200 000 EUR	CK Hutchison Finance 16 Ltd, 2.000%, 06/04/28	189 652	0,06
100 000 EUR	KBC Group NV, 0.375%, 16/06/27	93 104	0,03	Îles Caïmans – Total			
100 000 EUR	KBC Group NV, 4.375%, 23/11/27	102 283	0,03	370 661			
100 000 EUR	KBC Group NV, 0.750%, 21/01/28	91 970	0,03	République tchèque			
500 000 EUR	KBC Group NV, 0.125%, 14/01/29	437 300	0,14	100 000 EUR	Ceska sporitelna AS, 5.737%, 08/03/28	103 161	0,04
200 000 EUR	KBC Group NV, 4.250%, 28/11/29	205 410	0,07	100 000 EUR	CEZ AS, 4.875%, 16/04/25	101 294	0,03
100 000 EUR	KBC Group NV, 0.750%, 24/01/30	85 768	0,03	100 000 EUR	CEZ AS, 0.875%, 02/12/26	92 400	0,03
100 000 EUR	KBC Group NV, 3.000%, 25/08/30	97 340	0,03	100 000 EUR	CEZ AS, 2.375%, 06/04/27	95 989	0,03
100 000 EUR	KBC Group NV, 4.875%, 25/04/33	102 191	0,03	100 000 EUR	CEZ AS, 3.000%, 05/06/28	97 444	0,03
200 000 EUR	KBC Group NV, 4.375%, perpetual	207 427	0,07	République tchèque – Total			
100 000 EUR	Lonza Finance International NV, 1.625%, 21/04/27	95 716	0,03	490 288			
100 000 EUR	Proximus SADP, 1.875%, 01/10/25	97 558	0,03	Danemark			
100 000 EUR	Proximus SADP, 4.000%, 08/03/30	104 570	0,03	185 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 0.375%, 30/06/27	168 617	0,06
				100 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 4.000%, 05/10/28	103 586	0,03
				200 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 0.625%, 09/03/30	171 710	0,06
				100 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 4.250%, 05/10/33	106 212	0,04
				100 000 EUR	Danica Pension Livsforsikrings AB, 4.375%, 29/09/45	98 516	0,03
				200 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.750%, perpetual	153 730	0,05
				300 000 EUR	EON SE, 2.875%, perpetual	298 518	0,10
				100 000 EUR	ISS Global A/S, 0.875%, 18/06/26	93 634	0,03
				100 000 EUR	ISS Global A/S, 1.500%, 31/08/27	93 282	0,03

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Danemark (suite)				Finlande (suite)			
100 000 EUR	Jyske Bank A/S, 4.625%, 11/04/26	100 861	0,03	100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 1.000%, 22/05/25	96 638	0,03
180 000 EUR	Jyske Bank A/S, 0.050%, 02/09/26	168 972	0,06	100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.500%, 12/08/25	95 446	0,03
100 000 EUR	Jyske Bank A/S, 5.500%, 16/11/27	104 848	0,03	120 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.250%, 24/03/26	111 997	0,04
100 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 0.625%, 17/01/25	96 888	0,03	139 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 4.125%, 18/04/27	142 880	0,05
200 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 0.500%, 10/07/25	191 062	0,06	200 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.625%, 27/07/27	181 515	0,06
100 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 0.250%, 13/01/26	93 859	0,03	155 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.100%, 16/11/27	137 961	0,04
100 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 0.750%, 20/01/27	91 956	0,03	400 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 4.000%, 13/06/28	413 083	0,13
100 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 1.375%, 12/07/27	93 439	0,03	100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.625%, 12/11/29	85 621	0,03
100 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 4.000%, 17/07/28	101 174	0,03	200 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 1.625%, 09/06/30	191 019	0,06
100 000 EUR	Orsted AS, 3.625%, 01/03/26	100 389	0,03	100 000 EUR	Sampo Oyj, 3.375%, 23/05/49	94 009	0,03
100 000 EUR	Orsted AS, 2.250%, 14/06/28	96 044	0,03	200 000 EUR	Sampo Oyj, 2.500%, 03/09/52	167 662	0,05
200 000 EUR	Orsted AS, 1.500%, 26/11/29	180 678	0,06	200 000 EUR	Stora Enso Oyj, 4.000%, perpetual	202 205	0,06
300 000 EUR	Orsted AS, 3.750%, perpetual	306 672	0,10	Finlande – Total		5 307 557	1,71
300 000 EUR	Orsted AS, 4.125%, perpetual	311 796	0,10	France			
100 000 EUR	Orsted AS, 5.250%, perpetual	99 812	0,03	200 000 EUR	Abeille Vie Sa d'Assurances Vie et de Capitalisation SA, 6.250%, 09/09/33	217 146	0,07
100 000 EUR	Pandora A/S, 4.500%, 10/04/28	103 667	0,03	100 000 EUR	Accor SA, 3.000%, 04/02/26	96 070	0,03
200 000 EUR	Sydbank AS, 0.500%, 10/11/26	187 362	0,06	100 000 EUR	Accor SA, 2.375%, 29/11/28	95 177	0,03
100 000 EUR	Sydbank AS, 5.125%, 06/09/28	103 244	0,03	200 000 EUR	Aeroports de Paris SA, 1.000%, 13/12/27	186 803	0,06
100 000 EUR	TDC Net A/S, 5.056%, 31/05/28	103 609	0,03	300 000 EUR	Aeroports de Paris SA, 2.750%, 02/04/30	295 142	0,10
100 000 EUR	TDC Net A/S, 5.618%, 06/02/30	102 987	0,03	200 000 EUR	Aeroports de Paris SA, 1.500%, 02/07/32	175 786	0,06
200 000 EUR	Vestas Wind Systems A/S, 4.125%, 15/06/26	203 324	0,07	200 000 EUR	Aeroports de Paris SA, 1.125%, 18/06/34	162 777	0,05
Danemark – Total		4 230 448	1,36	200 000 EUR	Aeroports de Paris SA, 2.125%, 11/10/38	172 723	0,06
Finlande				200 000 EUR	ALD SA, 1.250%, 02/03/26	190 772	0,06
300 000 EUR	Balder Finland Oyj, 2.000%, 18/01/31	219 339	0,07	200 000 EUR	ALD SA, 4.000%, 05/07/27	203 996	0,07
100 000 EUR	Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 0.875%, 17/09/29	76 909	0,02	200 000 EUR	ALD SA, 4.875%, 06/10/28	211 578	0,07
200 000 EUR	Elenia Verkko Oyj, 0.375%, 06/02/27	181 748	0,06	100 000 EUR	Alstom SA, 0.250%, 14/10/26	90 427	0,03
300 000 EUR	Fortum Oyj, 2.125%, 27/02/29	283 052	0,09	100 000 EUR	Alstom SA, 0.125%, 27/07/27	87 640	0,03
200 000 EUR	Fortum Oyj, 4.000%, perpetual	205 076	0,07	200 000 EUR	Alstom SA, 0.500%, 27/07/30	160 896	0,05
200 000 EUR	Fortum Oyj, 4.500%, perpetual	212 132	0,07	200 000 EUR	APRR SA, 1.125%, 09/01/26	192 844	0,06
300 000 EUR	Kojamo Oyj, 1.875%, 27/05/27	267 878	0,09	300 000 EUR	APRR SA, 1.250%, 06/01/27	286 001	0,09
100 000 EUR	Neste Oyj, 3.875%, 16/03/29	102 995	0,03	100 000 EUR	APRR SA, 0.010%, 19/06/28	88 349	0,03
100 000 EUR	Neste Oyj, 3.875%, 21/05/31	103 727	0,03	100 000 EUR	APRR SA, 1.875%, 03/01/29	95 231	0,03
400 000 EUR	Nokia Oyj, 3.125%, 15/05/28	391 044	0,13	100 000 EUR	Arkema SA, 1.500%, 20/01/25	97 798	0,03
200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 4.375%, 06/09/26	202 489	0,07	200 000 EUR	Arkema SA, 0.750%, 03/12/29	174 634	0,06
500 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 14/05/27	461 417	0,15	100 000 EUR	Arkema SA, 4.250%, 20/05/30	104 400	0,03
200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 4.125%, 05/05/28	206 455	0,07	100 000 EUR	Arval Service Lease SA, 3.375%, 04/01/26	99 817	0,03
100 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 02/11/28	87 759	0,03	200 000 EUR	Arval Service Lease SA, 4.000%, 22/09/26	202 282	0,07
200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 2.500%, 23/05/29	192 080	0,06				
200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 2.875%, 24/08/32	193 421	0,06				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
300 000	EUR Arval Service Lease SA, 4.750%, 22/05/27	311 087	0,10	300 000	EUR BNP Paribas SA, 2.500%, 31/03/32	283 807	0,09
100 000	EUR Arval Service Lease SA, 4.250%, perpetual	101 100	0,03	400 000	EUR BNP Paribas SA, 2.100%, 07/04/32	356 626	0,12
200 000	EUR Autoroutes du Sud de la France SA, 1.000%, 13/05/26	190 942	0,06	200 000	EUR BNP Paribas SA, 4.125%, 26/09/32	209 337	0,07
200 000	EUR Autoroutes du Sud de la France SA, 2.750%, 02/09/32	193 838	0,06	200 000	EUR BNP Paribas SA, 4.750%, 13/11/32	211 999	0,07
300 000	EUR AXA SA, 3.750%, 12/10/30	316 062	0,10	100 000	EUR BNP Paribas SA, 0.875%, 31/08/33	85 748	0,03
400 000	EUR AXA SA, 3.625%, 10/01/33	423 786	0,14	200 000	EUR BNP Paribas SA, 4.250%, perpetual	206 915	0,07
100 000	EUR AXA SA, 1.875%, 10/07/42	82 111	0,03	200 000	EUR BNP Paribas SA, 4.125%, perpetual	210 730	0,07
100 000	EUR AXA SA, 4.250%, 10/03/43	98 612	0,03	400 000	EUR Bouygues SA, 0.500%, 11/02/30	346 764	0,11
100 000	EUR AXA SA, 3.375%, 06/07/47	97 679	0,03	100 000	EUR Bouygues SA, 4.625%, 07/06/32	109 734	0,04
300 000	EUR AXA SA, 3.250%, 28/05/49	287 782	0,09	200 000	EUR Bouygues SA, 3.250%, 30/06/37	195 203	0,06
100 000	EUR AXA SA, 5.500%, perpetual	107 047	0,03	300 000	EUR Bouygues SA, 5.375%, 30/06/42	356 136	0,12
200 000	EUR AXA SA, 3.875%, perpetual	196 965	0,06	200 000	EUR BPCE SA, 1.000%, 01/04/25	193 756	0,06
100 000	EUR Banque Stellantis France SACA, 0.010%, 22/01/25	96 105	0,03	200 000	EUR BPCE SA, 0.625%, 28/04/25	192 549	0,06
200 000	EUR Banque Stellantis France SACA, 3.875%, 19/01/26	201 400	0,07	200 000	EUR BPCE SA, 0.250%, 15/01/26	187 927	0,06
100 000	EUR BNP Paribas SA, 0.500%, 04/06/26	95 580	0,03	200 000	EUR BPCE SA, 1.375%, 23/03/26	191 801	0,06
350 000	EUR BNP Paribas SA, 1.125%, 11/06/26	332 996	0,11	200 000	EUR BPCE SA, 0.010%, 14/01/27	182 188	0,06
200 000	EUR BNP Paribas SA, 2.250%, 11/01/27	194 177	0,06	100 000	EUR BPCE SA, 0.500%, 24/02/27	91 487	0,03
400 000	EUR BNP Paribas SA, 2.125%, 23/01/27	388 381	0,13	100 000	EUR BPCE SA, 1.750%, 26/04/27	95 651	0,03
200 000	EUR BNP Paribas SA, 0.250%, 13/04/27	185 469	0,06	500 000	EUR BPCE SA, 0.500%, 15/09/27	460 985	0,15
200 000	EUR BNP Paribas SA, 0.375%, 14/10/27	184 348	0,06	300 000	EUR BPCE SA, 0.500%, 14/01/28	273 591	0,09
300 000	EUR BNP Paribas SA, 0.500%, 19/02/28	272 862	0,09	300 000	EUR BPCE SA, 3.500%, 25/01/28	303 134	0,10
200 000	EUR BNP Paribas SA, 1.500%, 23/05/28	187 189	0,06	200 000	EUR BPCE SA, 4.125%, 10/07/28	207 309	0,07
100 000	EUR BNP Paribas SA, 0.500%, 30/05/28	90 495	0,03	400 000	EUR BPCE SA, 4.375%, 13/07/28	413 141	0,13
500 000	EUR BNP Paribas SA, 0.500%, 01/09/28	448 116	0,14	300 000	EUR BPCE SA, 1.000%, 05/10/28	273 908	0,09
600 000	EUR BNP Paribas SA, 3.875%, 23/02/29	614 546	0,20	200 000	EUR BPCE SA, 0.625%, 15/01/30	171 125	0,06
500 000	EUR BNP Paribas SA, 1.125%, 17/04/29	451 119	0,15	200 000	EUR BPCE SA, 4.625%, 02/03/30	208 856	0,07
200 000	EUR BNP Paribas SA, 1.375%, 28/05/29	179 738	0,06	300 000	EUR BPCE SA, 4.000%, 29/11/32	313 060	0,10
200 000	EUR BNP Paribas SA, 3.625%, 01/09/29	200 532	0,07	100 000	EUR BPCE SA, 4.750%, 14/06/34	106 354	0,03
200 000	EUR BNP Paribas SA, 0.500%, 19/01/30	171 321	0,06	300 000	EUR BPCE SA, 5.125%, 25/01/35	308 483	0,10
200 000	EUR BNP Paribas SA, 0.875%, 11/07/30	172 333	0,06	200 000	EUR BPCE SA, 3.625%, perpetual	201 645	0,07
400 000	EUR BNP Paribas SA, 2.375%, 20/11/30	388 381	0,13	200 000	EUR Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 6.000%, 23/01/27	214 571	0,07
300 000	EUR BNP Paribas SA, 1.625%, 02/07/31	256 101	0,08	100 000	EUR Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 3.375%, 24/09/28	99 213	0,03
				100 000	EUR Capgemini SE, 0.625%, 23/06/25	96 000	0,03
				100 000	EUR Capgemini SE, 1.750%, 18/04/28	95 305	0,03
				200 000	EUR Capgemini SE, 2.000%, 15/04/29	191 185	0,06
				100 000	EUR Capgemini SE, 1.125%, 23/06/30	89 202	0,03
				200 000	EUR Capgemini SE, 2.375%, 15/04/32	189 522	0,06
				100 000	EUR Carrefour SA, 1.250%, 03/06/25	96 925	0,03
				200 000	EUR Carrefour SA, 1.750%, 04/05/26	193 897	0,06
				200 000	EUR Carrefour SA, 1.000%, 17/05/27	186 689	0,06
				200 000	EUR Carrefour SA, 4.125%, 12/10/28	207 849	0,07
				100 000	EUR Carrefour SA, 4.375%, 14/11/31	105 975	0,03
				200 000	EUR Carrefour SA, 3.750%, perpetual	203 958	0,07

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
200 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.000%, 17/03/25	194 500	0,06	400 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.000%, 22/04/26	385 817	0,12
100 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.625%, 10/08/25	97 341	0,03	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.000%, 12/10/26	201 542	0,07
100 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.125%, 23/03/26	95 741	0,03	400 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.875%, 20/12/26	384 792	0,12
100 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.750%, 29/11/26	101 629	0,03	300 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.625%, 17/03/27	290 688	0,09
200 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.875%, 29/11/30	206 583	0,07	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.875%, 22/04/27	96 365	0,03
300 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.875%, 15/03/31	276 653	0,09	300 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.375%, 03/05/27	284 119	0,09
300 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 2.625%, 10/08/32	287 753	0,09	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.375%, 28/07/27	201 225	0,07
100 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.875%, 03/09/25	96 258	0,03	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.125%, 09/12/27	177 434	0,06
300 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.010%, 02/11/28	264 223	0,09	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.375%, 20/04/28	88 226	0,03
200 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 2.500%, 03/09/38	186 360	0,06	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.000%, 25/03/29	184 980	0,06
200 000 EUR	CNP Assurances SACA, 0.375%, 08/03/28	175 875	0,06	300 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.250%, 11/07/29	309 048	0,10
200 000 EUR	CNP Assurances SACA, 4.250%, 05/06/45	198 930	0,06	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.500%, 29/08/29	96 285	0,03
300 000 EUR	CNP Assurances SACA, 2.000%, 27/07/50	259 781	0,08	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.500%, 21/09/29	174 267	0,06
100 000 EUR	CNP Assurances SACA, 5.250%, 18/07/53	103 391	0,03	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.875%, 14/01/32	164 151	0,05
500 000 EUR	Coentreprise de Transport d'Electricite SA, 2.125%, 29/07/32	452 077	0,15	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.125%, 12/07/32	167 678	0,05
300 000 EUR	Cofiroute SA, 1.125%, 13/10/27	282 007	0,09	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.000%, 18/01/33	209 848	0,07
100 000 EUR	Cofiroute SA, 0.750%, 09/09/28	91 515	0,03	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 5.500%, 28/08/33	209 856	0,07
200 000 EUR	Cofiroute SA, 1.000%, 19/05/31	173 176	0,06	300 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.375%, 27/11/33	314 952	0,10
100 000 EUR	Covivio Hotels SACA, 1.000%, 27/07/29	87 226	0,03	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.500%, 22/04/34	183 368	0,06
200 000 EUR	Covivio SA, 1.500%, 21/06/27	187 711	0,06	300 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.875%, 28/11/34	313 876	0,10
100 000 EUR	Covivio SA, 1.625%, 23/06/30	88 587	0,03	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.875%, 20/06/26	206 475	0,07
100 000 EUR	Covivio SA, 1.125%, 17/09/31	82 174	0,03	300 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.375%, 17/01/25	292 966	0,09
100 000 EUR	Covivio SA, 4.625%, 05/06/32	103 599	0,03	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.250%, 01/06/26	100 151	0,03
100 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 2.000%, 17/07/30	87 559	0,03	200 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.875%, 07/05/27	184 918	0,06
300 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 1.500%, 06/10/31	244 964	0,08	200 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.375%, 19/09/27	200 609	0,07
100 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 5.875%, 25/10/33	109 725	0,04	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.125%, 23/05/29	89 435	0,03
100 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 4.750%, 27/09/48	100 810	0,03	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.250%, 11/06/29	90 621	0,03
100 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 4.500%, perpetual	99 357	0,03	300 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.750%, 18/01/30	257 770	0,08
200 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 4.250%, perpetual	198 493	0,06	200 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA 4.250%, 01/12/32	210 100	0,07
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.375% 13/03/25	97 490	0,03				
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.125%, 05/02/26	200 015	0,06				
300 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.250%, 14/04/26	287 378	0,09				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.875%, 11/03/33			100 000 EUR	Kering SA, 3.250%, 27/02/29	101 675	0,03
200 000 EUR	Danone SA, 1.125%, 14/01/25	194 896	0,06	200 000 EUR	Kering SA, 3.625%, 05/09/31	206 761	0,07
200 000 EUR	Danone SA, 0.010%, 01/12/25	188 769	0,06	300 000 EUR	Kering SA, 3.375%, 27/02/33	305 439	0,10
200 000 EUR	Danone SA, 0.571%, 17/03/27	187 539	0,06	200 000 EUR	Kering SA, 3.875%, 05/09/35	209 596	0,07
100 000 EUR	Danone SA, 3.706%, 13/11/29	104 201	0,03	300 000 EUR	Klepierre SA, 1.875%, 19/02/26	291 592	0,09
200 000 EUR	Danone SA, 0.520%, 09/11/30	169 503	0,06	100 000 EUR	Klepierre SA, 1.375%, 16/02/27	94 639	0,03
200 000 EUR	Danone SA, 3.470%, perpetual	205 264	0,07	100 000 EUR	Klepierre SA, 2.000%, 12/05/29	93 695	0,03
100 000 EUR	Danone SA, 1.000%, perpetual	91 277	0,03	100 000 EUR	Klepierre SA, 0.625%, 01/07/30	83 167	0,03
200 000 EUR	Dassault Systemes SE, 0.125%, 16/09/26	186 224	0,06	100 000 EUR	La Banque Postale SA, 0.500%, 17/06/26	95 494	0,03
200 000 EUR	Dassault Systemes SE, 0.375%, 16/09/29	175 918	0,06	100 000 EUR	La Banque Postale SA, 0.250%, 12/07/26	92 907	0,03
200 000 EUR	Edenred SE, 1.375%, 10/03/25	194 851	0,06	200 000 EUR	La Banque Postale SA, 4.000%, 03/05/28	205 647	0,07
100 000 EUR	Edenred SE, 1.875%, 06/03/26	97 318	0,03	200 000 EUR	La Banque Postale SA, 2.000%, 13/07/28	188 716	0,06
100 000 EUR	Edenred SE, 3.625%, 13/12/26	101 313	0,03	100 000 EUR	La Banque Postale SA, 4.375%, 17/01/30	103 149	0,03
100 000 EUR	Edenred SE, 1.375%, 18/06/29	91 904	0,03	100 000 EUR	La Banque Postale SA, 0.875%, 26/01/31	93 340	0,03
100 000 EUR	Edenred SE, 3.625%, 13/06/31	101 715	0,03	100 000 EUR	La Banque Postale SA, 0.750%, 23/06/31	81 954	0,03
100 000 EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.375%, 30/10/26	95 835	0,03	100 000 EUR	La Banque Postale SA, 5.500%, 05/03/34	104 534	0,03
200 000 EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.750%, 30/04/30	184 912	0,06	200 000 EUR	La Banque Postale SA, 1.000%, perpetual	183 894	0,06
400 000 EUR	Gecina SA, 1.375%, 30/06/27	380 871	0,12	100 000 EUR	La Mondiale SAM, 0.750%, 20/04/26	93 655	0,03
100 000 EUR	Gecina SA, 1.375%, 26/01/28	93 672	0,03	100 000 EUR	La Mondiale SAM, 5.050%, perpetual	99 840	0,03
100 000 EUR	Gecina SA, 1.625%, 14/03/30	92 500	0,03	400 000 EUR	La Poste SA, 0.625%, 21/10/26	374 576	0,12
100 000 EUR	Gecina SA, 1.625%, 29/05/34	86 779	0,03	300 000 EUR	La Poste SA, 0.010%, 18/07/29	253 515	0,08
400 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2.250%, 24/03/25	391 730	0,13	400 000 EUR	La Poste SA, 3.750%, 12/06/30	413 955	0,13
100 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 2.500%, 04/05/27	96 957	0,03	500 000 EUR	La Poste SA, 0.625%, 18/01/36	368 197	0,12
100 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.625%, 18/09/29	89 800	0,03	200 000 EUR	Legrand SA, 0.750%, 20/05/30	174 961	0,06
100 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 4.250%, 18/03/30	102 723	0,03	100 000 EUR	Legrand SA, 1.875%, 06/07/32	93 357	0,03
500 000 EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.100%, 03/09/27	448 187	0,14	200 000 EUR	L'Oreal SA, 0.875%, 29/06/26	190 601	0,06
300 000 EUR	ICADE, 1.750%, 10/06/26	286 126	0,09	100 000 EUR	L'Oreal SA, 3.375%, 23/01/27	101 630	0,03
100 000 EUR	ICADE, 1.625%, 28/02/28	92 884	0,03	200 000 EUR	L'Oreal SA, 2.875%, 19/05/28	200 840	0,07
100 000 EUR	ICADE, 1.000%, 19/01/30	84 820	0,03	100 000 EUR	L'Oreal SA, 3.375%, 23/11/29	103 071	0,03
100 000 EUR	ICADE, 0.625%, 18/01/31	78 808	0,03	200 000 EUR	L'Oreal SA, 3.125%, perpetual	199 650	0,06
100 000 EUR	Imerys SA, 1.500%, 15/01/27	93 593	0,03	200 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.750%, 07/04/25	193 820	0,06
200 000 EUR	Indigo Group SAS, 1.625%, 19/04/28	185 988	0,06	200 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.010%, 11/02/26	188 393	0,06
100 000 EUR	Indigo Group SAS, 4.500%, 18/04/30	103 919	0,03	200 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.125%, 11/02/28	180 700	0,06
300 000 EUR	JCDecaux SE, 2.625%, 24/04/28	293 377	0,10	300 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.250%, 07/09/29	305 359	0,10
100 000 EUR	JCDecaux SE, 5.000%, 11/01/29	105 031	0,03	300 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.500%, 07/09/33	309 813	0,10
100 000 EUR	Kering SA, 1.250%, 10/05/26	96 000	0,03	300 000 EUR	Orange SA, 1.000%, 12/05/25	290 342	0,09
200 000 EUR	Kering SA, 3.625%, 05/09/27	204 430	0,07	200 000 EUR	Orange SA, 1.000%, 12/09/25	192 731	0,06
100 000 EUR	Kering SA, 0.750%, 13/05/28	91 546	0,03	100 000 EUR	Orange SA, 0.875%, 03/02/27	94 166	0,03
				100 000 EUR	Orange SA, 1.500%, 09/09/27	95 828	0,03

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
200 000 EUR	Orange SA, 2.000%, 15/01/29	192 004	0,06	200 000 EUR	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 2.000%, 18/04/36	172 823	0,06
300 000 EUR	Orange SA, 1.375%, 16/01/30	275 473	0,09	300 000 EUR	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 2.125%, 27/09/38	256 858	0,08
200 000 EUR	Orange SA, 3.625%, 16/11/31	208 528	0,07	100 000 EUR	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 1.125%, 09/09/49	65 058	0,02
400 000 EUR	Orange SA, 0.500%, 04/09/32	326 018	0,11	100 000 EUR	Schlumberger Finance France SAS, 1.000%, 18/02/26	95 633	0,03
300 000 EUR	Orange SA, 8.125%, 28/01/33	420 198	0,14	100 000 EUR	SCOR SE, 3.000%, 08/06/46	97 106	0,03
200 000 EUR	Orange SA, 0.625%, 16/12/33	159 981	0,05	200 000 EUR	SCOR SE, 3.625%, 27/05/48	196 755	0,06
100 000 EUR	Orange SA, 3.875%, 11/09/35	106 325	0,03	300 000 EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, 0.500%, 21/04/28	268 770	0,09
300 000 EUR	Orange SA, 5.000%, perpetual	305 412	0,10	200 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 24/02/26	187 227	0,06
100 000 EUR	Orange SA, 1.750%, perpetual	88 538	0,03	200 000 EUR	Societe Generale SA, 4.250%, 28/09/26	204 903	0,07
200 000 EUR	Orange SA, 2.375%, perpetual	194 120	0,06	200 000 EUR	Societe Generale SA, 0.750%, 25/01/27	183 890	0,06
200 000 EUR	Orange SA, 5.375%, perpetual	208 999	0,07	100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.250%, 08/07/27	89 969	0,03
100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.500%, 18/05/26	96 944	0,03	200 000 EUR	Societe Generale SA, 4.000%, 16/11/27	204 638	0,07
100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.750%, 15/09/27	102 507	0,03	400 000 EUR	Societe Generale SA, 1.375%, 13/01/28	370 798	0,12
100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 0.500%, 24/10/27	91 873	0,03	300 000 EUR	Societe Generale SA, 0.875%, 22/09/28	272 142	0,09
100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.250%, 02/11/28	101 462	0,03	400 000 EUR	Societe Generale SA, 2.125%, 27/09/28	377 676	0,12
200 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.750%, 08/04/30	185 442	0,06	100 000 EUR	Societe Generale SA, 4.125%, 21/11/28	103 471	0,03
200 000 EUR	Pernod Ricard SA, 0.875%, 24/10/31	170 565	0,06	500 000 EUR	Societe Generale SA, 1.750%, 22/03/29	454 108	0,15
200 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.750%, 02/11/32	209 302	0,07	200 000 EUR	Societe Generale SA, 2.625%, 30/05/29	194 330	0,06
100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.750%, 15/09/33	104 082	0,03	300 000 EUR	Societe Generale SA, 0.500%, 12/06/29	259 926	0,08
100 000 EUR	Praemia Healthcare SACA, 5.500%, 19/09/28	104 611	0,03	400 000 EUR	Societe Generale SA, 4.750%, 28/09/29	416 555	0,13
100 000 EUR	PSA Tresorerie GIE, 6.000%, 19/09/33	117 930	0,04	100 000 EUR	Societe Generale SA, 1.000%, 24/11/30	93 745	0,03
100 000 EUR	RCI Banque SA, 1.625%, 11/04/25	97 531	0,03	300 000 EUR	Societe Generale SA, 1.125%, 30/06/31	275 558	0,09
100 000 EUR	RCI Banque SA, 4.125%, 01/12/25	100 658	0,03	400 000 EUR	Societe Generale SA, 4.875%, 21/11/31	417 943	0,14
100 000 EUR	RCI Banque SA, 1.625%, 26/05/26	95 583	0,03	300 000 EUR	Societe Generale SA, 4.250%, 16/11/32	318 510	0,10
100 000 EUR	RCI Banque SA, 4.625%, 02/10/26	102 536	0,03	100 000 EUR	Societe Generale SA, 5.625%, 02/06/33	106 542	0,03
100 000 EUR	RCI Banque SA, 4.500%, 06/04/27	102 621	0,03	150 000 EUR	Sodexo SA, 0.750%, 27/04/25	144 873	0,05
300 000 EUR	RCI Banque SA, 4.750%, 06/07/27	312 892	0,10	100 000 EUR	Sodexo SA, 2.500%, 24/06/26	98 361	0,03
100 000 EUR	RCI Banque SA, 4.875%, 14/06/28	105 098	0,03	100 000 EUR	Sodexo SA, 1.000%, 27/04/29	90 796	0,03
211 000 EUR	RCI Banque SA, 4.875%, 21/09/28	223 156	0,07	300 000 EUR	Suez SACA, 4.625%, 03/11/28	317 626	0,10
100 000 EUR	RCI Banque SA, 4.875%, 02/10/29	105 109	0,03	100 000 EUR	Suez SACA, 2.375%, 24/05/30	94 125	0,03
100 000 EUR	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 1.625%, 27/11/25	97 202	0,03	200 000 EUR	Suez SACA, 5.000%, 03/11/32	220 932	0,07
500 000 EUR	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 2.750%, 20/06/29	493 629	0,16				
300 000 EUR	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 3.750%, 04/07/35	313 048	0,10				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
100 000 EUR	Suez SACA, 4.500%, 13/11/33	106 697	0,03	100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.940%, 07/01/30	93 487	0,03
300 000 EUR	TDF Infrastructure SASU, 2.500%, 07/04/26	292 104	0,09	200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.625%, 17/09/30	182 338	0,06
200 000 EUR	Teleperformance SE, 0.250%, 26/11/27	178 274	0,06	100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 6.125%, 25/11/33	124 249	0,04
200 000 EUR	Teleperformance SE, 3.750%, 24/06/29	199 002	0,06	100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.250%, 14/05/35	81 416	0,03
200 000 EUR	Terega SA, 0.875%, 17/09/30	169 064	0,05	100 000 EUR	Verallia SA, 1.625%, 14/05/28	93 261	0,03
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0.875%, 21/02/25	96 713	0,03	100 000 EUR	Verallia SA, 1.875%, 10/11/31	87 793	0,03
300 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.125%, 09/04/25	293 947	0,10	300 000 EUR	Vinci SA, 1.000%, 26/09/25	290 001	0,09
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.125%, 15/09/25	192 498	0,06	100 000 EUR	Vinci SA, 1.625%, 18/01/29	94 219	0,03
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.375%, 09/03/26	191 745	0,06	200 000 EUR	Vinci SA, 1.750%, 26/09/30	185 742	0,06
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0.625%, 04/05/27	182 872	0,06	300 000 EUR	Vinci SA, 3.375%, 17/10/32	305 214	0,10
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.875%, 15/01/31	89 682	0,03	200 000 EUR	Vivendi SE, 0.625%, 11/06/25	192 305	0,06
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.375%, 04/12/31	168 751	0,05	100 000 EUR	Wendel SE, 2.500%, 09/02/27	96 735	0,03
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0.875%, 29/03/32	79 913	0,03	100 000 EUR	Worldline SA, 0.875%, 30/06/27	90 129	0,03
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.000%, 29/06/32	88 506	0,03	100 000 EUR	Worldline SA, 4.125%, 12/09/28,	98 751	0,03
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.375%, 25/05/33	164 236	0,05	140 000 EUR	WPP Finance SA, 4.125% perpetual	144 389	0,05
400 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.750%, 27/02/34	339 389	0,11	France – Total		64 168 082	20,70
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.000%, 28/04/36	83 300	0,03	Allemagne			
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.000%, 29/05/37	81 581	0,03	200 000 EUR	Aareal Bank AG, 4.500%, 25/07/25	200 289	0,07
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.250%, 14/05/38	82 041	0,03	100 000 EUR	adidas AG, 3.000%, 21/11/25	100 029	0,03
300 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 7.250%, perpetual	299 063	0,10	100 000 EUR	adidas AG, 3.125%, 21/11/29	101 713	0,03
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.000%, 03/04/25	97 068	0,03	100 000 EUR	adidas AG, 0.625%, perpetual	77 066	0,03
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 0.010%, 09/06/26	185 817	0,06	100 000 EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.625%, 25/11/28	91 167	0,03
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.496%, 30/11/26	96 249	0,03	300 000 EUR	Allianz SE, 4.597%, 07/09/38	307 097	0,10
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 0.010%, 14/01/27	182 778	0,06	100 000 EUR	Allianz SE, 2.241%, 07/07/45	97 022	0,03
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 4.625%, 30/03/27	209 987	0,07	100 000 EUR	Allianz SE, 1.301%, 25/09/49	86 181	0,03
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.250%, 02/04/27	94 751	0,03	100 000 EUR	Allianz SE, 2.121%, 08/07/50	88 007	0,03
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.590%, 10/01/28	188 459	0,06	500 000 EUR	Allianz SE, 4.252%, 05/07/52	494 180	0,16
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.250%, 15/04/28	93 561	0,03	200 000 EUR	Allianz SE, 5.824%, 25/07/53	218 531	0,07
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.250%, 19/05/28	186 044	0,06	100 000 EUR	Amprion GmbH, 3.450%, 22/09/27	101 060	0,03
				100 000 EUR	Amprion GmbH, 3.875%, 07/09/28	103 073	0,03
				300 000 EUR	Amprion GmbH, 3.971%, 22/09/32	312 306	0,10
				100 000 EUR	Amprion GmbH, 4.125%, 07/09/34	105 065	0,03
				200 000 EUR	BASF SE, 0.875%, 22/05/25	193 795	0,06
				300 000 EUR	BASF SE, 0.750%, 17/03/26	284 910	0,09
				100 000 EUR	BASF SE, 0.875%, 15/11/27	92 467	0,03
				200 000 EUR	BASF SE, 4.000%, 08/03/29	208 762	0,07
				500 000 EUR	BASF SE, 1.500%, 17/03/31	449 670	0,15
				100 000 EUR	BASF SE, 4.250%, 08/03/32	106 343	0,03
				100 000 EUR	BASF SE, 3.750%, 29/06/32	103 391	0,03
				100 000 EUR	BASF SE, 1.625%, 15/11/37	82 592	0,03
				100 000 EUR	Bayerische Landesbank, 4.250%, 21/06/27	102 321	0,03
				100 000 EUR	Bayerische Landesbank, 3.750%, 07/02/29	100 741	0,03
				100 000 EUR	Bayerische Landesbank, 1.375%, 22/11/32	81 899	0,03
				100 000 EUR	Berlin Hyp AG, 1.000%, 05/02/26	94 776	0,03

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
200 000 EUR	Berlin Hyp AG, 0.375%, 21/04/31	157 517	0,05	100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 3.625%, 18/12/37	104 194	0,03
200 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 1.250%, 29/09/25	193 487	0,06	100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.875%, 23/06/39	71 916	0,02
100 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 2.000%, 01/04/28	95 884	0,03	100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 3.875%, 13/10/42	107 609	0,04
100 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 3.500%, 29/05/29	101 267	0,03	210 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.125%, 29/05/51	131 896	0,04
100 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 1.500%, 15/05/30	90 170	0,03	200 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.950%, perpetual	190 653	0,06
200 000 EUR	Commerzbank AG, 0.100%, 11/09/25	189 460	0,06	100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.600%, perpetual	84 273	0,03
300 000 EUR	Commerzbank AG, 1.000%, 04/03/26	286 482	0,09	200 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 3.875%, 28/09/26	204 320	0,07
100 000 EUR	Commerzbank AG, 0.750%, 24/03/26	95 969	0,03	100 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 3.750%, 28/09/29	103 969	0,03
200 000 EUR	Commerzbank AG, 0.875%, 22/01/27	185 732	0,06	400 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.500%, 04/04/32	362 272	0,12
100 000 EUR	Commerzbank AG, 3.000%, 14/09/27	97 801	0,03	200 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 3.875%, 28/09/33	212 778	0,07
100 000 EUR	Commerzbank AG, 1.875%, 28/02/28	94 911	0,03	200 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.250%, 16/06/47	180 667	0,06
100 000 EUR	Commerzbank AG, 4.625%, 21/03/28	102 256	0,03	100 000 EUR	Deutsche Kreditbank AG, 0.010%, 23/02/26	92 596	0,03
200 000 EUR	Commerzbank AG, 1.500%, 28/08/28	190 709	0,06	300 000 EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.100%, 02/02/26	268 281	0,09
200 000 EUR	Commerzbank AG, 5.250%, 25/03/29	209 946	0,07	100 000 EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 4.375%, 28/08/26	98 430	0,03
200 000 EUR	Continental AG, 0.375%, 27/06/25	191 884	0,06	300 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.250%, 01/04/26	290 736	0,09
100 000 EUR	Continental AG, 3.625%, 30/11/27	101 512	0,03	300 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.000%, 13/12/27	280 497	0,09
100 000 EUR	Continental AG, 4.000%, 01/06/28	103 154	0,03	100 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.625%, 05/12/28	95 085	0,03
100 000 EUR	Covestro AG, 4.750%, 15/11/28	106 444	0,04	200 000 EUR	Deutsche Post AG, 3.375%, 03/07/33	204 102	0,07
100 000 EUR	Covestro AG, 1.375%, 12/06/30	89 760	0,03	200 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 0.500%, 05/07/27	186 213	0,06
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 3.750%, 09/07/25	100 962	0,03	300 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 1.750%, 25/03/31	281 420	0,09
300 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.250%, 23/10/25	292 028	0,09	200 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 1.375%, 05/07/34	172 670	0,06
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.750%, 02/03/26	95 644	0,03	200 000 EUR	Deutsche Wohnen SE, 1.000%, 30/04/25	191 423	0,06
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 3.500%, 20/09/27	102 790	0,03	100 000 EUR	EON SE, 0.875%, 08/01/25	97 442	0,03
300 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.125%, 18/12/28	278 001	0,09	100 000 EUR	EON SE, 1.000%, 07/10/25	96 427	0,03
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 2.750%, 19/03/29	100 003	0,03	60 000 EUR	EON SE, 0.125%, 18/01/26	56 530	0,02
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.875%, 24/05/30	94 296	0,03	107 000 EUR	EON SE, 3.750%, 01/03/29	110 657	0,04
300 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.375%, 28/03/31	244 161	0,08	200 000 EUR	EON SE, 1.625%, 29/03/31	180 578	0,06
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.875%, 11/07/31	87 085	0,03	200 000 EUR	EON SE, 0.600%, 01/10/32	162 466	0,05
300 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.500%, 08/12/32	270 375	0,09	131 000 EUR	EON SE, 4.000%, 29/08/33	137 744	0,05
250 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.375%, 03/03/34	214 182	0,07	205 000 EUR	EON SE, 0.875%, 18/10/34	164 795	0,05
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.625%, 15/04/36	74 526	0,02	215 000 EUR	EON SE, 3.875%, 12/01/35	223 256	0,07
				100 000 EUR	EON SE, 0.875%, perpetual	80 388	0,03
				300 000 EUR	Eurogrid GmbH, 1.875%, 10/06/25	293 200	0,10
				200 000 EUR	Eurogrid GmbH, 3.722%, 27/04/30	203 878	0,07

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
100 000 EUR	Eurogrid GmbH, 3.279%, 05/09/31	99 374	0,03	100 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.125%, 16/07/25	95 134	0,03
100 000 EUR	Eurogrid GmbH, 0.741%, 21/04/33	78 763	0,03	100 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 1.875%, 15/06/26	97 377	0,03
200 000 EUR	Evonik Industries AG, 2.250%, 25/09/27	193 264	0,06	300 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 2.375%, 15/06/30	290 064	0,09
200 000 EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.375%, 09/03/26	183 620	0,06	100 000 EUR	Merck Kgaa, 2.875%, 25/06/79	91 639	0,03
100 000 EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 4.875%, 30/03/27	100 930	0,03	200 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 1.250%, 26/05/41	165 466	0,05
100 000 EUR	Hannover Rueck SE, 1.125%, 09/10/39	84 909	0,03	300 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 1.000%, 26/05/42	236 427	0,08
100 000 EUR	Hannover Rueck SE, 1.375%, 30/06/42	80 643	0,03	200 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3.250%, 26/05/49	193 573	0,06
100 000 EUR	Hannover Rueck SE, 5.875%, 26/08/43	111 438	0,04	100 000 EUR	Norddeutsche Landesbank-Girozentrale, 4.875%, 11/07/28	106 166	0,03
200 000 EUR	Hannover Rueck SE, 3.375%, perpetual	196 387	0,06	200 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 3.625%, perpetual	204 199	0,07
200 000 EUR	Heidelberg Materials AG, 1.500%, 07/02/25	196 174	0,06	200 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 3.625%, perpetual	205 377	0,07
200 000 EUR	Hella GmbH & Co KGaA, 0.500%, 26/01/27	181 994	0,06	200 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 4.000%, perpetual	211 787	0,07
200 000 EUR	Henkel AG & Co KGaA, 0.500%, 17/11/32	165 626	0,05	200 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 4.375%, perpetual	214 115	0,07
100 000 EUR	KION Group AG, 1.625%, 24/09/25	95 035	0,03	300 000 EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.500%, 30/06/26	306 470	0,10
400 000 EUR	Knorr-Bremse AG, 1.125%, 13/06/25	387 776	0,13	200 000 EUR	SAP SE, 1.000%, 01/04/25	195 658	0,06
200 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 3.625%, 16/06/25	197 593	0,06	300 000 EUR	SAP SE, 0.125%, 18/05/26	282 128	0,09
100 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 2.875%, 28/09/26	96 928	0,03	350 000 EUR	SAP SE, 1.750%, 22/02/27	345 955	0,11
200 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.375%, 18/02/27	181 054	0,06	300 000 EUR	SAP SE, 0.375%, 18/05/29	266 416	0,09
200 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.375%, 07/05/29	167 159	0,05	200 000 EUR	Talanx AG, 4.000%, 25/10/29	208 034	0,07
200 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.375%, 21/02/31	156 780	0,05	200 000 EUR	Talanx AG, 1.750%, 01/12/42	165 180	0,05
300 000 EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 0.375%, 12/05/25	287 418	0,09	100 000 EUR	Talanx AG, 2.250%, 05/12/47	93 152	0,03
100 000 EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 2.625%, 24/08/27	97 657	0,03	100 000 EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.000%, 26/09/27	102 743	0,03
100 000 EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 0.375%, 04/06/29	85 479	0,03	100 000 EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.625%, 26/09/32	108 740	0,04
100 000 EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 4.000%, 04/02/30	103 343	0,03	100 000 EUR	Vier Gas Transport GmbH, 0.500%, 10/09/34	73 649	0,02
100 000 EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 4.500%, 15/09/32	95 448	0,03	200 000 EUR	Vonovia SE, 0.010%, 01/12/25	186 343	0,06
100 000 EUR	LEG Immobilien SE, 0.375%, 17/01/26	93 499	0,03	400 000 EUR	Vonovia SE, 4.750%, 23/05/27	414 228	0,13
100 000 EUR	LEG Immobilien SE, 0.875%, 17/01/29	87 145	0,03	400 000 EUR	Vonovia SE, 0.375%, 16/06/27	357 222	0,12
100 000 EUR	LEG Immobilien SE, 1.500%, 17/01/34	78 219	0,03	200 000 EUR	Vonovia SE, 0.250%, 01/09/28	169 668	0,06
				300 000 EUR	Vonovia SE, 0.625%, 14/12/29	247 000	0,08
				200 000 EUR	Vonovia SE, 5.000%, 23/11/30	211 008	0,07
				100 000 EUR	Vonovia SE, 0.750%, 01/09/32	75 825	0,03
				200 000 EUR	Vonovia SE, 1.000%, 16/06/33	151 744	0,05

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Allemagne (suite)				Irlande (suite)			
100 000 EUR	Vonovia SE, 1.500%, 14/06/41	64 836	0,02	200 000 EUR	ESB Finance DAC, 1.875%, 14/06/31	183 162	0,06
300 000 EUR	WPP Finance Deutschland GmbH, 1.625%, 23/03/30	272 836	0,09	200 000 EUR	ESB Finance DAC, 4.000%, 03/05/32	211 124	0,07
Allemagne – Total		25 040 026	8,08	100 000 EUR	ESB Finance DAC, 4.250%, 03/03/36	107 653	0,04
Hong Kong				300 000 EUR	Johnson Controls International PLC, 4.250%, 23/05/35	317 688	0,10
300 000 EUR	AIA Group Ltd, 0.880%, 09/09/33	255 313	0,08	100 000 EUR	Kerry Group Financial Services Unltd Co, 2.375%, 10/09/25	98 583	0,03
Hong-Kong – Total		255 313	0,08	200 000 EUR	Kerry Group Financial Services Unltd Co, 0.875%, 01/12/31	169 293	0,06
Hongrie				200 000 EUR	Linde PLC, 1.000%, 31/03/27	189 015	0,06
200 000 EUR	MOL Hungarian Oil & Gas PLC, 1.500%, 08/10/27	180 767	0,06	100 000 EUR	Linde PLC, 3.375%, 12/06/29	102 720	0,03
100 000 EUR	OTP Bank Nyrt, 6.125%, 05/10/27	103 231	0,03	100 000 EUR	Linde PLC, 1.375%, 31/03/31	90 056	0,03
Hongrie – Total		283 998	0,09	100 000 EUR	Linde PLC, 0.375%, 30/09/33	77 692	0,03
Irlande				200 000 EUR	Linde PLC, 3.625%, 12/06/34	209 329	0,07
200 000 EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 1.500%, 27/09/26	192 854	0,06	100 000 EUR	Linde PLC, 1.625%, 31/03/35	85 781	0,03
100 000 EUR	AIB Group PLC, 2.250%, 03/07/25	98 241	0,03	100 000 EUR	Linde PLC, 1.000%, 30/09/51	60 363	0,02
400 000 EUR	AIB Group PLC, 3.625%, 04/07/26	399 922	0,13	300 000 EUR	Lunar Funding V for Swisscom AG, 1.750%, 15/09/25	293 146	0,10
100 000 EUR	AIB Group PLC, 2.250%, 04/04/28	95 829	0,03	100 000 EUR	Permanent TSB Group Holdings PLC, 6.625%, 25/04/28	105 487	0,03
200 000 EUR	AIB Group PLC, 5.750%, 16/02/29	214 933	0,07	100 000 EUR	Permanent TSB Group Holdings PLC, 6.625%, 30/06/29	107 005	0,03
100 000 EUR	AIB Group PLC, 5.250%, 23/10/31	108 004	0,04	100 000 EUR	Ryanair DAC, 2.875%, 15/09/25	98 990	0,03
100 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 1.875%, 05/06/26	97 229	0,03	200 000 EUR	Ryanair DAC, 0.875%, 25/05/26	188 630	0,06
200 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 0.375%, 10/05/27	185 888	0,06	100 000 EUR	Securitas Treasury Ireland DAC, 4.375%, 06/03/29	103 400	0,03
100 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 4.875%, 16/07/28	104 491	0,03	100 000 EUR	Securitas Treasury Ireland DAC, 4.250%, perpetual	101 824	0,03
200 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 5.000%, 04/07/31	213 385	0,07	300 000 EUR	Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2.875%, 15/01/26	295 212	0,10
100 000 EUR	CAAUTO Bank SPA/Ireland, 4.750%, 25/01/27	103 265	0,03	150 000 EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.000%, 22/09/33	119 830	0,04
100 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.010%, 06/09/25	94 544	0,03	100 000 EUR	Vodafone International Financing DAC, 3.750%, 02/12/34	103 038	0,03
200 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.500%, 06/09/29	173 143	0,06	100 000 EUR	Vodafone International Financing DAC, 3.250%, perpetual	101 156	0,03
300 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.875%, 06/05/33	242 332	0,08	Irlande – Total		7 000 761	2,26
300 000 EUR	Cloverie PLC for Zurich Insurance Co Ltd, 1.500%, 15/12/28	281 180	0,09	Italie			
200 000 EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.000%, 11/07/27	205 337	0,07	100 000 EUR	2i Rete Gas SpA, 2.195%, 11/09/25	97 958	0,03
100 000 EUR	CRH SMW Finance DAC, 4.000%, 11/07/31	103 829	0,03	100 000 EUR	2i Rete Gas SpA, 1.608%, 31/10/27	93 928	0,03
100 000 EUR	Dell Bank International DAC, 4.500%, 18/10/27	104 097	0,03	100 000 EUR	2i Rete Gas SpA, 4.375%, 06/06/33	102 247	0,03
100 000 EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.950%, 15/09/31	79 421	0,03	180 000 EUR	A2A SpA, 2.500%, 15/06/26	176 636	0,06
100 000 EUR	ESB Finance DAC, 2.125%, 08/06/27	96 378	0,03	100 000 EUR	A2A SpA, 1.500%, 16/03/28	93 588	0,03
100 000 EUR	ESB Finance DAC, 4.000%, 03/10/28	103 656	0,03	100 000 EUR	A2A SpA, 4.500%, 19/09/30	105 109	0,03
100 000 EUR	ESB Finance DAC, 1.750%, 07/02/29	93 954	0,03	100 000 EUR	A2A SpA, 0.625%, 15/07/31	80 469	0,03
100 000 EUR	ESB Finance DAC, 1.125%, 11/06/30	88 672	0,03	100 000 EUR	A2A SpA, 4.375%, perpetual	104 211	0,03
				100 000 EUR	ACEA SpA, 1.000%, 24/10/26	94 205	0,03
				100 000 EUR	ACEA SpA, 1.500%, 08/06/27	94 423	0,03
				100 000 EUR	ACEA SpA, 1.750%, 23/05/28	94 192	0,03

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Italie (suite)				Italie (suite)			
180 000 EUR	ACEA SpA, 0.250%, 28/07/30	147 905	0,05	250 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.625%, 24/02/26	234 899	0,08
100 000 EUR	ACEA SpA, 3.875%, 24/01/31	102 486	0,03	169 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.375%, 29/08/27	173 353	0,06
300 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 4.125%, 04/05/26	301 221	0,10	400 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.750%, 06/09/27	414 450	0,13
175 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.429%, 14/07/31	152 286	0,05	200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.000%, 08/03/28	206 875	0,07
200 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.399%, 20/04/33	211 872	0,07	200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.750%, 16/03/28	179 933	0,06
200 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.272%, 12/09/33	210 542	0,07	100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.750%, 20/03/28	93 312	0,03
200 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.500%, 27/10/47	207 264	0,07	100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.750%, 04/07/29	91 030	0,03
150 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.000%, 08/06/48	154 100	0,05	175 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.250%, 13/01/30	187 344	0,06
500 000 EUR	ASTM SpA, 2.375%, 25/11/33	418 612	0,13	200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.125%, 29/08/31	213 159	0,07
400 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.750%, 01/02/27	378 163	0,12	500 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.000%, perpetual	507 063	0,16
400 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 1.625%, 25/01/28	367 595	0,12	100 000 EUR	Iren SpA, 1.950%, 19/09/25	97 677	0,03
200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 2.000%, 04/12/28	183 543	0,06	400 000 EUR	Iren SpA, 1.500%, 24/10/27	377 451	0,12
200 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 5.125%, 14/06/33	209 093	0,07	100 000 EUR	Italgas SpA, 1.625%, 19/01/27	95 559	0,03
200 000 EUR	CAAUTO Bank SPA/Ireland, 4.375%, 08/06/26	203 057	0,07	100 000 EUR	Italgas SpA, 0.010%, 16/02/28	88 422	0,03
100 000 EUR	Cassa Centrale Banca - Credito Cooperativo Italiano SpA, 5.885%, 16/02/27	103 494	0,03	100 000 EUR	Italgas SpA, 1.625%, 18/01/29	93 471	0,03
200 000 EUR	Credito Emiliano SpA, 4.875%, 26/03/30	206 256	0,07	50 000 EUR	Italgas SpA, 0.875%, 24/04/30	42 983	0,01
500 000 EUR	Enel SpA, 5.625%, 21/06/27	538 404	0,17	200 000 EUR	Italgas SpA, 4.125%, 08/06/32	206 573	0,07
200 000 EUR	Enel SpA, 6.375%, 31/12/99	208 842	0,07	300 000 EUR	Leasys SpA, 4.625%, 16/02/27	307 605	0,10
100 000 EUR	Enel SpA, 6.625%, 31/12/99	106 241	0,03	80 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.125%, 15/07/25	76 982	0,02
400 000 EUR	Enel SpA, 3.500%, perpetual	391 906	0,13	200 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.875%, 15/01/26	190 141	0,06
400 000 EUR	Enel SpA, 3.375%, perpetual	380 443	0,12	180 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.000%, 08/09/27	165 679	0,05
100 000 EUR	Enel SpA, 1.375%, perpetual	87 173	0,03	300 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 4.875%, 13/09/27	308 287	0,10
100 000 EUR	Enel SpA, 1.875%, perpetual	78 852	0,02	200 000 EUR	Pirelli & C SpA, 4.250%, 18/01/28	207 571	0,07
300 000 EUR	Enel SpA, 2.250%, perpetual	274 527	0,09	200 000 EUR	Snam SpA, 0.875%, 25/10/26	188 361	0,06
300 000 EUR	Eni SpA, 0.625%, 23/01/30	258 209	0,08	100 000 EUR	Snam SpA, 0.010%, 07/12/28	85 726	0,03
400 000 EUR	Eni SpA, 1.500%, 02/02/26	384 693	0,12	190 000 EUR	Snam SpA, 0.750%, 20/06/29	165 678	0,05
100 000 EUR	Eni SpA, 1.250%, 18/05/26	95 781	0,03	100 000 EUR	Snam SpA, 0.750%, 17/06/30	84 921	0,03
100 000 EUR	Eni SpA, 1.500%, 17/01/27	95 443	0,03	300 000 EUR	Snam SpA, 1.250%, 20/06/34	242 307	0,08
100 000 EUR	Eni SpA, 0.375%, 14/06/28	88 980	0,03	320 000 EUR	Snam SpA, 1.000%, 12/09/34	247 562	0,08
300 000 EUR	Eni SpA, 1.125%, 19/09/28	275 641	0,09	100 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.000%, 10/04/26	95 343	0,03
400 000 EUR	Eni SpA, 3.625%, 29/01/29	410 603	0,13	100 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.375%, 26/07/27	94 178	0,03
300 000 EUR	Eni SpA, 2.625%, perpetual	287 313	0,09	100 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.000%, 11/10/28	91 095	0,03
200 000 EUR	Eni SpA, 2.750%, perpetual	171 053	0,05	200 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.375%, 23/06/29	172 606	0,06
500 000 EUR	Eni SpA, 3.375%, perpetual	456 610	0,15				
200 000 EUR	ERG SpA, 1.875%, 11/04/25	195 949	0,06				
25 000 EUR	ERG SpA, 0.875%, 15/09/31	20 067	0,01				
100 000 EUR	Hera SpA, 0.250%, 03/12/30	80 351	0,03				
200 000 EUR	Hera SpA, 4.250%, perpetual	207 439	0,07				
100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 2.125%, 26/05/25	97 964	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Italie (suite)				Jersey			
100 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.375%, 25/09/30	82 663	0,03	300 000 EUR	Aptiv PLC, 1.500%, 10/03/25	291 951	0,09
200 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.875%, 24/07/33	206 072	0,07	200 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 1.875%, 12/07/32	174 787	0,06
100 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.625%, perpetual	102 004	0,03	200 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 4.500%, 11/07/33	212 575	0,07
490 000 EUR	UniCredit SpA, 0.500%, 09/04/25	470 733	0,15	400 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 1.875%, 14/03/34	336 338	0,11
200 000 EUR	UniCredit SpA, 0.325%, 19/01/26	188 226	0,06	Jersey – Total		1 015 651	0,33
300 000 EUR	UniCredit SpA, 1.200%, 20/01/26	291 085	0,09	Liechtenstein			
290 000 EUR	UniCredit SpA, 1.250%, 16/06/26	279 789	0,09	200 000 EUR	Swiss Life Finance I Ltd, 3.250%, 31/08/29	200 155	0,06
312 000 EUR	UniCredit SpA, 5.850%, 15/11/27	330 065	0,11	100 000 EUR	Swiss Life Finance I Ltd, 0.500%, 15/09/31	80 967	0,03
100 000 EUR	UniCredit SpA, 4.600%, 14/02/30	104 278	0,03	Liechtenstein – Total		281 122	0,09
400 000 EUR	UniCredit SpA, 0.850%, 19/01/31	329 466	0,11	Luxembourg			
400 000 EUR	Unipol Gruppo SpA, 3.000%, 18/03/25	394 704	0,13	100 000 EUR	Acef Holding SCA, 0.750%, 14/06/28	85 880	0,03
Italie – Total		18 693 620	6,03	100 000 EUR	Acef Holding SCA, 1.250%, 26/04/30	80 089	0,03
Japon				200 000 EUR	Aroundtown SA, 0.010%, 16/07/26	167 784	0,05
100 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 0.336%, 19/04/27	91 016	0,03	200 000 EUR	Aroundtown SA, 0.375%, 15/04/27	160 188	0,05
165 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 0.541%, 23/10/28	145 552	0,05	200 000 EUR	Aroundtown SA, 1.625%, 31/01/28	161 883	0,05
300 000 EUR	Mitsubishi ufj Financial Group Inc, 3.556%, perpetual	306 228	0,10	200 000 EUR	Aroundtown SA, 2.875%, perpetual	69 800	0,02
300 000 EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0.337%, 08/06/27	278 821	0,09	200 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.208%, 04/06/26	190 778	0,06
300 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.184%, 13/04/26	279 685	0,09	100 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.213%, 12/02/36	77 285	0,03
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 1.631%, 08/04/27	94 618	0,03	374 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.336%, 13/08/41	256 659	0,08
300 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 1.598%, 10/04/28	281 535	0,09	200 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1.250%, 26/04/27	175 302	0,06
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.157%, 20/05/28	102 550	0,03	100 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1.625%, 20/04/30	79 956	0,03
300 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.470%, 06/09/29	258 800	0,08	100 000 EUR	CBRE Global Investors Open-Ended Funds SCA SICAV-SIF-Pan European Core Fund, 0.500%, 27/01/28	88 130	0,03
200 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.608%, 28/08/30	211 727	0,07	400 000 EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0.750%, 17/04/26	376 545	0,12
200 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 2.096%, 08/04/32	179 058	0,06	100 000 EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.125%, 17/10/28	90 152	0,03
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.416%, 20/05/33	105 145	0,03	100 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.875%, 19/01/26	97 027	0,03
500 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.010%, 03/03/25	479 712	0,15	100 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.750%, 25/03/27	95 637	0,03
200 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1.546%, 15/06/26	191 674	0,06	100 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.625%, 03/07/29	90 880	0,03
200 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1.413%, 14/06/27	187 662	0,06	100 000 EUR	CPI Property Group SA, 2.750%, 12/05/26	83 105	0,03
200 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0.632%, 23/10/29	170 961	0,06	300 000 EUR	CPI Property Group SA, 1.625%, 23/04/27	219 716	0,07
200 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 4.492%, 12/06/30	210 740	0,07	100 000 EUR	CPI Property Group SA, 1.500%, 27/01/31	52 030	0,02
Japon – Total		3 575 484	1,15				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Luxembourg (suite)				Luxembourg (suite)			
300 000 EUR	Czech Gas Networks Investments Sarl, 0.875%, 31/03/31	239 875	0,08	200 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.250%, 15/01/31	205 635	0,07
300 000 EUR	Grand City Properties SA, 1.500%, 22/02/27	270 812	0,09	200 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 1.250%, 29/03/31	179 672	0,06
300 000 EUR	Grand City Properties SA, 1.500%, perpetual	134 361	0,04	300 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.750%, 13/03/33	321 697	0,10
200 000 EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.500%, 14/06/27	191 946	0,06	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.375%, 15/11/34	103 328	0,03
400 000 EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.750%, 24/04/28	380 945	0,12	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.375%, 03/12/40	66 401	0,02
400 000 EUR	Helvetia Europe SA, 2.750%, 30/09/41	345 938	0,11	370 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.875%, 14/06/41	265 368	0,09
100 000 EUR	Highland Holdings Sarl, 0.318%, 15/12/26	92 152	0,03	300 000 EUR	Novartis Finance SA, 1.625%, 09/11/26	292 263	0,09
100 000 EUR	Highland Holdings Sarl, 0.934%, 15/12/31	82 616	0,03	500 000 EUR	Novartis Finance SA, 0.010%, 23/09/28	441 935	0,14
100 000 EUR	John Deere Bank SA, 2.500%, 14/09/26	98 843	0,03	200 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 3.125%, 01/06/31	192 777	0,06
200 000 EUR	John Deere Cash Management SARL, 1.850%, 02/04/28	193 046	0,06	200 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 1.625%, 17/06/32	167 535	0,05
100 000 EUR	John Deere Cash Management SARL, 1.650%, 13/06/39	80 602	0,03	100 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 0.750%, 23/03/33	76 210	0,02
200 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.250%, 02/07/25	190 802	0,06	200 000 EUR	Repsol Europe Finance Sarl, 0.375%, 06/07/29	172 867	0,06
200 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.010%, 15/10/25	188 944	0,06	100 000 EUR	Segro Capital Sarl, 1.250%, 23/03/26	95 478	0,03
100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.625%, 15/10/25	98 727	0,03	100 000 EUR	Segro Capital Sarl, 1.875%, 23/03/30	91 654	0,03
200 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.125%, 07/03/27	188 929	0,06	100 000 EUR	SES SA, 1.625%, 22/03/26	95 108	0,03
100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.625%, 07/03/31	90 557	0,03	235 000 EUR	SES SA, 3.500%, 14/01/29	230 603	0,07
100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.125%, 15/10/31	100 298	0,03	200 000 EUR	Simon International Finance SCA, 1.125%, 19/03/33	161 033	0,05
215 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.750%, 15/10/32	177 032	0,06	200 000 EUR	SIX Finance Luxembourg SA, 0.010%, 02/12/25	187 595	0,06
170 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.375%, 15/10/34	171 273	0,06	200 000 EUR	Swiss Re Finance Luxembourg SA, 2.534%, 30/04/50	185 114	0,06
200 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.250%, 07/03/39	170 160	0,06	100 000 EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.250%, 02/11/26	94 466	0,03
200 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.500%, 02/07/39	152 392	0,05	200 000 EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.100%, 09/11/27	184 146	0,06
150 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.375%, 15/10/40	109 506	0,04	Luxembourg – Total		11 548 096	3,72
400 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.625%, 15/10/50	271 657	0,09	Mexique			
100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.010%, 03/12/25	94 812	0,03	300 000 EUR	America Movil SAB de CV, 0.750%, 26/06/27	276 295	0,09
200 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.010%, 14/06/26	187 488	0,06	Mexique – Total		276 295	0,09
343 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.500%, 13/12/27	354 018	0,11	Pays-Bas			
100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.000%, 15/03/28	101 880	0,03	400 000 EUR	ABB Finance BV, 3.250%, 16/01/27	404 391	0,13
300 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 1.500%, 01/04/30	278 774	0,09	100 000 EUR	ABB Finance BV, 3.375%, 16/01/31	102 475	0,03
				300 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.000%, 16/04/25	291 032	0,09
				200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.750%, 20/04/25	200 705	0,07
				400 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.875%, 21/12/26	408 060	0,13

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
500 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.000%, 16/01/28	512 400	0,17	100 000 EUR	BMW Finance NV, 4.125%, 04/10/33	107 699	0,04
200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.375%, 20/10/28	207 310	0,07	400 000 EUR	BMW Finance NV, 3.250%, perpetual	403 213	0,13
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.500%, 23/09/29	84 885	0,03	300 000 EUR	BMW Finance NV, 3.250%, perpetual	306 495	0,10
200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.250%, 21/02/30	207 714	0,07	300 000 EUR	BMW Finance NV, 3.625%, perpetual	311 711	0,10
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.250%, 21/02/30	103 857	0,03	100 000 EUR	BP Capital Markets BV, 1.467%, 21/09/41	70 648	0,02
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.000%, 01/06/32	97 384	0,03	200 000 EUR	BP Capital Markets BV, 3.773%, perpetual	206 719	0,07
200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 5.125%, 22/02/33	205 705	0,07	200 000 EUR	BP Capital Markets BV, 4.323%, perpetual	211 863	0,07
200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.000%, 02/06/33	165 450	0,05	100 000 EUR	Brenntag Finance BV, 1.125%, 27/09/25	96 247	0,03
200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 5.500%, 21/09/33	209 237	0,07	100 000 EUR	Brenntag Finance BV, 0.500%, 06/10/29	85 380	0,03
200 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 0.600%, 15/01/27	184 467	0,06	100 000 EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 2.750%, 23/09/25	99 027	0,03
200 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 1.250%, 20/01/34	161 895	0,05	100 000 EUR	Coloplast Finance BV, 2.750%, 19/05/30	96 668	0,03
100 000 EUR	Achmea BV, 3.625%, 29/11/25	100 340	0,03	100 000 EUR	Compass Group Finance Netherlands BV, 1.500%, 05/09/28	94 256	0,03
200 000 EUR	Achmea BV, 1.500%, 26/05/27	189 355	0,06	400 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.125%, 14/07/25	404 393	0,13
100 000 EUR	Achmea BV, 4.250%, perpetual	98 870	0,03	300 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.250%, 23/03/26	288 990	0,09
300 000 EUR	Akelius Residential Property Financing BV, 1.125%, 11/01/29	247 459	0,08	200 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 3.913%, 03/11/26	204 409	0,07
400 000 EUR	Akzo Nobel NV, 1.625%, 14/04/30	360 818	0,12	200 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.375%, 03/02/27	190 092	0,06
300 000 EUR	Alliander NV, 2.625%, 09/09/27	298 307	0,10	300 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.375%, 01/12/27	275 074	0,09
100 000 EUR	Alliander NV, 3.250%, 13/06/28	101 901	0,03	200 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.625%, 27/01/28	207 036	0,07
200 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.875%, 15/01/26	192 233	0,06	200 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.875%, 05/05/28	184 267	0,06
300 000 EUR	Allianz Finance II BV, 1.500%, 15/01/30	279 805	0,09	200 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.000%, 10/01/30	206 501	0,07
100 000 EUR	Arcadis NV, 4.875%, 28/02/28	103 489	0,03	200 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.125%, 07/05/31	171 627	0,06
100 000 EUR	Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 1.125%, 17/09/25	96 373	0,03	100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 3.875%, 30/11/32	99 948	0,03
100 000 EUR	Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co Ltd, 3.500%, 01/10/46	98 443	0,03	200 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.625%, 25/02/33	159 163	0,05
200 000 EUR	ASML Holding NV, 1.625%, 28/05/27	192 057	0,06	200 000 EUR	CRH Funding BV, 1.625%, 05/05/30	182 121	0,06
400 000 EUR	ASML Holding NV, 0.625%, 07/05/29	357 418	0,12	100 000 EUR	CTP NV, 0.625%, 27/09/26	89 832	0,03
100 000 EUR	ASML Holding NV, 0.250%, 25/02/30	85 836	0,03	300 000 EUR	CTP NV, 1.250%, 21/06/29	247 544	0,08
200 000 EUR	ASR Nederland NV, 7.000%, 07/12/43	225 151	0,07	200 000 EUR	CTP NV, 1.500%, 27/09/31	154 845	0,05
200 000 EUR	ASR Nederland NV, 3.375%, 02/05/49	185 224	0,06	100 000 EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.250%, 06/04/25	97 197	0,03
300 000 EUR	BMW Finance NV, 0.875%, 03/04/25	290 973	0,09	100 000 EUR	Daimler Truck International Finance BV, 1.625%, 06/04/27	95 635	0,03
300 000 EUR	BMW Finance NV, 0.750%, 13/07/26	284 154	0,09	100 000 EUR	Daimler Truck International Finance BV, 3.875%, 19/06/29	103 253	0,03
100 000 EUR	BMW Finance NV, 3.875%, 04/10/28	104 462	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
200 000 EUR	Danfoss Finance I BV, 0.125%, 28/04/26	185 707	0,06	100 000 EUR	Enel Finance International NV, 4.000%, 20/02/31	103 327	0,03
200 000 EUR	Danfoss Finance II BV, 0.750%, 28/04/31	165 942	0,05	110 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.125%, 17/10/34	85 098	0,03
200 000 EUR	de Volksbank NV, 0.250%, 22/06/26	183 983	0,06	300 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.250%, 17/01/35	235 167	0,08
200 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.375%, 01/12/25	194 386	0,06	100 000 EUR	Enel Finance International NV, 4.500%, 20/02/43	102 878	0,03
400 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.375%, 30/01/27	384 307	0,12	200 000 EUR	Enexis Holding NV, 0.750%, 02/07/31	171 089	0,06
200 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 7.500%, 24/01/33	268 452	0,09	105 000 EUR	Enexis Holding NV, 0.625%, 17/06/32	87 069	0,03
200 000 EUR	Diageo Capital BV, 1.500%, 08/06/29	186 118	0,06	100 000 EUR	Essity Capital BV, 3.000%, 21/09/26	99 528	0,03
100 000 EUR	Diageo Capital BV, 1.875%, 08/06/34	88 652	0,03	100 000 EUR	Essity Capital BV, 0.250%, 15/09/29	87 031	0,03
200 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 0.625%, 15/07/25	189 384	0,06	100 000 EUR	Euronext NV, 1.000%, 18/04/25	96 546	0,03
200 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 1.500%, 15/03/30	173 832	0,06	200 000 EUR	Euronext NV, 0.125%, 17/05/26	185 895	0,06
127 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 1.000%, 15/01/32	101 102	0,03	100 000 EUR	Euronext NV, 0.750%, 17/05/31	83 252	0,03
135 000 EUR	Digital Intrepid Holding BV, 1.375%, 18/07/32	109 844	0,04	100 000 EUR	Euronext NV, 1.500%, 17/05/41	74 996	0,02
200 000 EUR	DSM BV, 1.000%, 09/04/25	194 274	0,06	300 000 EUR	Evonik Industries AG, 0.750%, 07/09/28	274 826	0,09
200 000 EUR	DSM BV, 0.750%, 28/09/26	189 650	0,06	100 000 EUR	Ferrovial SE, 4.375%, 13/09/30	105 358	0,03
135 000 EUR	DSM BV, 0.250%, 23/06/28	121 369	0,04	200 000 EUR	Givaudan Finance Europe BV, 1.000%, 22/04/27	189 299	0,06
295 000 EUR	DSV Finance BV, 1.375%, 16/03/30	266 638	0,09	100 000 EUR	Givaudan Finance Europe BV, 1.625%, 22/04/32	89 328	0,03
300 000 EUR	DSV Finance BV, 0.750%, 05/07/33	239 035	0,08	100 000 EUR	Givaudan Finance Europe BV, 4.125%, 28/11/33	106 395	0,04
100 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.000%, 13/04/25	96 906	0,03	400 000 EUR	Haleon Netherlands Capital BV, 1.250%, 29/03/26	383 373	0,12
100 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.625%, 30/05/26	97 033	0,03	190 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 0.625%, 24/07/25	168 169	0,05
300 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.500%, 31/07/29	278 589	0,09	200 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 1.375%, 03/03/27	157 945	0,05
200 000 EUR	Edp Finance BV, 1.875%, 21/09/29	186 635	0,06	300 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 1.625%, 13/10/31	188 588	0,06
400 000 EUR	EDP Finance BV, 1.625%, 26/01/26	386 595	0,13	300 000 EUR	Heineken NV, 1.625%, 30/03/25	293 540	0,10
100 000 EUR	EDP Finance BV, 3.875%, 11/03/30	103 412	0,03	100 000 EUR	Heineken NV, 2.875%, 04/08/25	99 394	0,03
100 000 EUR	ELM BV for Firmenich International SA, 3.750%, perpetual	97 681	0,03	200 000 EUR	Heineken NV, 3.625%, 15/11/26	203 103	0,07
200 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.966%, 27/01/25	196 385	0,06	100 000 EUR	Heineken NV, 2.250%, 30/03/30	95 831	0,03
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.250%, 17/11/25	94 590	0,03	200 000 EUR	Heineken NV, 3.875%, 23/09/30	209 382	0,07
150 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.375%, 01/06/26	143 561	0,05	200 000 EUR	Heineken NV, 1.750%, 17/03/31	183 139	0,06
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 3.875%, 09/03/29	103 246	0,03	200 000 EUR	Heineken NV, 4.125%, 23/03/35	214 559	0,07
270 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.500%, 17/06/30	226 082	0,07	100 000 EUR	Iberdrola International BV, 0.375%, 15/09/25	95 515	0,03
				200 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.825%, perpetual	169 431	0,06
				400 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.874%, perpetual	375 688	0,12
				200 000 EUR	Iberdrola International BV, 3.250%, perpetual	197 301	0,06
				100 000 EUR	IMCD NV, 4.875%, 18/09/28	104 682	0,03
				600 000 EUR	ING Bank NV, 4.125%, 02/10/26	614 418	0,20
				400 000 EUR	ING Groep NV, 2.125%, 23/05/26	391 112	0,13
				300 000 EUR	ING Groep NV, 1.250%, 16/02/27	285 183	0,09

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
200 000 EUR	ING Groep NV, 4.875%, 14/11/27	207 320	0,07	100 000 EUR	LYB International Finance II BV, 1.625%, 17/09/31	86 829	0,03
200 000 EUR	ING Groep NV, 1.375%, 11/01/28	187 952	0,06	300 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.250%, 09/09/29	257 977	0,08
300 000 EUR	ING Groep NV, 0.375%, 29/09/28	266 132	0,09	130 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.625%, 09/09/32	104 802	0,03
200 000 EUR	ING Groep NV, 2.000%, 22/03/30	193 464	0,06	100 000 EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands, 0.375%, 26/02/25	96 270	0,03
200 000 EUR	ING Groep NV, 2.500%, 15/11/30	191 289	0,06	200 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.250%, 15/01/26	191 618	0,06
300 000 EUR	ING Groep NV, 0.875%, 29/11/30	260 327	0,09	200 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.250%, 19/04/26	191 473	0,06
300 000 EUR	ING Groep NV, 1.750%, 16/02/31	268 157	0,09	400 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.375%, 19/01/27	379 086	0,12
100 000 EUR	ING Groep NV, 1.000%, 16/11/32	88 386	0,03	200 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.500%, 29/01/28	188 035	0,06
200 000 EUR	ING Groep NV, 4.125%, 24/08/33	200 603	0,07	400 000 EUR	NE Property BV, 1.875%, 09/10/26	364 583	0,12
200 000 EUR	ING Groep NV, 5.250%, 14/11/33	219 546	0,07	200 000 EUR	Nederlandse Gasunie NV, 1.000%, 11/05/26	191 226	0,06
200 000 EUR	ING Groep NV, 5.000%, 20/02/35	206 605	0,07	200 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.875%, 08/07/25	191 141	0,06
200 000 EUR	ING Groep NV, 0.250%, perpetual	173 447	0,06	300 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.250%, 09/09/26	273 978	0,09
200 000 EUR	ING Groep NV, 4.500%, perpetual	206 002	0,07	100 000 EUR	NN Group NV, 1.625%, 01/06/27	96 101	0,03
200 000 EUR	JAB Holdings BV, 1.625%, 30/04/25	194 963	0,06	200 000 EUR	NN Group NV, 0.875%, 23/11/31	171 192	0,06
100 000 EUR	JAB Holdings BV, 1.750%, 25/06/26	96 336	0,03	100 000 EUR	NN Group NV, 5.250%, 01/03/43	101 887	0,03
100 000 EUR	JAB Holdings BV, 1.000%, 20/12/27	91 773	0,03	200 000 EUR	NN Group NV, 6.000%, 03/11/43	213 106	0,07
100 000 EUR	JAB Holdings BV, 2.000%, 18/05/28	95 073	0,03	200 000 EUR	NN Group NV, 4.500%, perpetual	198 780	0,06
100 000 EUR	JAB Holdings BV, 2.500%, 25/06/29	96 053	0,03	100 000 EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 0.750%, 31/03/25	96 926	0,03
100 000 EUR	JAB Holdings BV, 4.750%, 29/06/32	106 289	0,04	100 000 EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 1.125%, 30/09/27	94 695	0,03
100 000 EUR	JAB Holdings BV, 3.375%, 17/04/35	95 085	0,03	200 000 EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 0.125%, 04/06/28	179 453	0,06
200 000 EUR	JAB Holdings BV, 2.250%, 19/12/39	155 172	0,05	100 000 EUR	PACCAR Financial Europe BV, 3.375%, perpetual	100 950	0,03
200 000 EUR	JDE Peet's NV, 0.010%, 16/01/26	186 896	0,06	215 000 EUR	Prosus NV, 1.207%, 19/01/26	201 953	0,07
100 000 EUR	JDE Peet's NV, 0.625%, 09/02/28	89 508	0,03	300 000 EUR	Prosus NV, 2.031%, 03/08/32	228 883	0,07
100 000 EUR	JDE Peet's NV, 4.125%, 23/01/30	102 828	0,03	300 000 EUR	Prosus NV, 2.778%, 19/01/34	233 323	0,08
100 000 EUR	JDE Peet's NV, 4.500%, 23/01/34	105 042	0,03	200 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.375%, 19/05/26	188 402	0,06
100 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 0.625%, 09/04/25	96 393	0,03	100 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.750%, 19/05/30	87 577	0,03
200 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 1.125%, 11/09/28	184 245	0,06	100 000 EUR	Redexis Gas Finance BV, 1.875%, 27/04/27	93 994	0,03
200 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 3.875%, 03/07/31	207 208	0,07	100 000 EUR	RELX Finance BV, 1.500%, 13/05/27	95 658	0,03
100 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 0.875%, 14/12/32	81 442	0,03	100 000 EUR	RELX Finance BV, 0.500%, 10/03/28	90 674	0,03
100 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 2.125%, 06/05/25	98 135	0,03	100 000 EUR	RELX Finance BV, 3.750%, 12/06/31	103 984	0,03
305 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 0.250%, 23/02/26	283 962	0,09	100 000 EUR	Rentokil Initial Finance BV, 3.875%, 27/06/27	101 838	0,03
200 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 0.250%, 07/09/26	183 550	0,06	100 000 EUR	Rentokil Initial Finance BV, 4.375%, 27/06/30	105 560	0,03
200 000 EUR	Linde Finance BV, 0.550%, 19/05/32	165 465	0,05	100 000 EUR	Repsol International Finance BV, 2.625%, 15/04/30	98 065	0,03
100 000 EUR	Louis Dreyfus Co Finance BV, 2.375%, 27/11/25	97 566	0,03				
100 000 EUR	Louis Dreyfus Co Finance BV, 1.625%, 28/04/28	92 806	0,03				
100 000 EUR	LYB International Finance II BV, 0.875%, 17/09/26	93 621	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
100 000 EUR	Repsol International Finance BV, 4.500%, 25/03/75	99 487	0,03	200 000 EUR	TenneT Holding BV, 2.125%, 17/11/29	192 232	0,06
200 000 EUR	Repsol International Finance BV, 2.500%, perpetual	186 601	0,06	150 000 EUR	TenneT Holding BV, 0.875%, 03/06/30	137 587	0,05
200 000 EUR	Repsol International Finance BV, 3.750%, perpetual	195 552	0,06	100 000 EUR	TenneT Holding BV, 2.000%, 05/06/34	90 593	0,03
200 000 EUR	Repsol International Finance BV, 4.247%, perpetual	194 966	0,06	200 000 EUR	TenneT Holding BV, 4.500%, 28/10/34	220 920	0,07
100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 0.875%, 25/02/25	97 487	0,03	200 000 EUR	TenneT Holding BV, 0.875%, 16/06/35	173 339	0,06
100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.312%, 04/12/27	102 309	0,03	100 000 EUR	TenneT Holding BV, 1.500%, 03/06/39	86 454	0,03
100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.204%, 27/08/29	102 502	0,03	300 000 EUR	TenneT Holding BV, 0.500%, 30/11/40	246 637	0,08
100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.355%, 27/02/35	104 115	0,03	100 000 EUR	TenneT Holding BV, 4.750%, 28/10/42	115 021	0,04
100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.586%, 04/12/36	105 804	0,03	250 000 EUR	TenneT Holding BV, 1.625%, perpetual	243 968	0,08
200 000 EUR	Royal Schiphol Group NV, 0.375%, 08/09/27	182 253	0,06	200 000 EUR	TenneT Holding BV, 2.375%, perpetual	189 626	0,06
195 000 EUR	Royal Schiphol Group NV, 2.000%, 06/04/29	185 136	0,06	100 000 EUR	TenneT Holding BV, 2.750%, perpetual	92 372	0,03
150 000 EUR	Royal Schiphol Group NV, 0.875%, 08/09/32	124 423	0,04	200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.800%, 18/10/30	173 425	0,06
100 000 EUR	Royal Schiphol Group NV, 0.750%, 22/04/33	80 273	0,03	200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.125%, 18/10/33	166 098	0,05
300 000 EUR	Schlumberger Finance BV, 1.375%, 28/10/26	286 392	0,09	200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.625%, 18/10/41	150 370	0,05
200 000 EUR	Schlumberger Finance BV, 0.250%, 15/10/27	180 838	0,06	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.250%, 25/03/25	97 489	0,03
100 000 EUR	Schlumberger Finance BV, 2.000%, 06/05/32	91 749	0,03	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.875%, 31/07/25	96 598	0,03
100 000 EUR	Signify NV, 2.375%, 11/05/27	96 783	0,03	200 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.125%, 29/04/28	186 597	0,06
200 000 EUR	Sika Capital BV, 3.750%, 03/11/26	203 288	0,07	200 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.375%, 31/07/29	185 565	0,06
100 000 EUR	Sika Capital BV, 0.875%, 29/04/27	93 358	0,03	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 3.250%, 23/02/31	102 126	0,03
200 000 EUR	Stedin Holding NV, 0.010%, 16/11/26	182 787	0,06	300 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.625%, 12/02/33	268 943	0,09
100 000 EUR	Stedin Holding NV, 0.500%, 14/11/29	86 112	0,03	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 3.500%, 23/02/35	104 215	0,03
100 000 EUR	Stedin Holding NV, 2.375%, 03/06/30	95 334	0,03	200 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 3.500%, 23/02/35	208 430	0,07
100 000 EUR	Stedin Holding NV, 1.500%, perpetual	89 354	0,03	100 000 EUR	Universal Music Group NV, 3.000%, 30/06/27	99 969	0,03
200 000 EUR	Stellantis NV, 3.875%, 05/01/26	201 602	0,07	200 000 EUR	Universal Music Group NV, 4.000%, 13/06/31	208 685	0,07
200 000 EUR	Stellantis NV, 4.500%, 07/07/28	210 460	0,07	100 000 EUR	Universal Music Group NV, 3.750%, 30/06/32	102 839	0,03
500 000 EUR	Stellantis NV, 4.375%, 14/03/30	527 578	0,17	100 000 EUR	Vestas Wind Systems Finance BV, 1.500%, 15/06/29	91 422	0,03
500 000 EUR	Stellantis NV, 4.250%, 16/06/31	518 206	0,17	100 000 EUR	Vestas Wind Systems Finance BV, 2.000%, 15/06/34	87 460	0,03
100 000 EUR	Technip Energies NV, 1.125%, 28/05/28	90 053	0,03	100 000 EUR	Vesteda Finance BV, 1.500%, 24/05/27	94 148	0,03
100 000 EUR	Telefonica Europe BV, 5.875%, 14/02/33	120 003	0,04	200 000 EUR	Vesteda Finance BV, 0.750%, 18/10/31	160 467	0,05
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 1.000%, 13/06/26	96 294	0,03				
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 0.125%, 09/12/27	93 591	0,03				
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 3.875%, 28/10/28	104 032	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Norvège (suite)			
100 000 EUR	Viterra Finance BV, 0.375%, 24/09/25	94 318	0,03	100 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.375%, 15/07/27	91 619	0,03
100 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.750%, 25/01/27	94 966	0,03	100 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 4.875%, 24/08/28	105 223	0,03
300 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.125%, 14/09/34	223 495	0,07	100 000 EUR	Statkraft AS, 1.125%, 20/03/25	97 187	0,03
100 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.625%, 07/10/39	68 928	0,02	100 000 EUR	Statkraft AS, 1.500%, 26/03/30	91 734	0,03
100 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.000%, 28/01/41	59 612	0,02	100 000 EUR	Statnett SF, 0.875%, 08/03/25	96 882	0,03
100 000 EUR	Wabtec Transportation Netherlands BV, 1.250%, 03/12/27	91 993	0,03	200 000 EUR	Telenor ASA, 2.500%, 22/05/25	197 514	0,06
300 000 EUR	Wintershall Dea Finance BV, 0.840%, 25/09/25	285 201	0,09	100 000 EUR	Telenor ASA, 0.750%, 31/05/26	94 588	0,03
100 000 EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.332%, 25/09/28	89 040	0,03	100 000 EUR	Telenor ASA, 0.250%, 25/09/27	90 693	0,03
78 000 EUR	Wolters Kluwer NV, 1.500%, 22/03/27	74 552	0,02	100 000 EUR	Telenor ASA, 0.250%, 14/02/28	89 578	0,03
200 000 EUR	Wolters Kluwer NV, 0.750%, 03/07/30	173 483	0,06	200 000 EUR	Telenor ASA, 1.125%, 31/05/29	181 572	0,06
100 000 EUR	Wolters Kluwer NV, 3.750%, perpetual	103 613	0,03	100 000 EUR	Telenor ASA, 4.000%, 03/10/30	105 585	0,03
100 000 EUR	Wurth Finance International BV, 0.750%, 22/11/27	92 287	0,03	100 000 EUR	Telenor ASA, 1.750%, 31/05/34	87 718	0,03
100 000 EUR	Wurth Finance International BV, 2.125%, 23/08/30	94 100	0,03	100 000 EUR	Telenor ASA, 4.250%, 03/10/35	108 542	0,04
Pays-Bas – Total		46 868 878	15,12			4 434 416	1,43
Nouvelle-Zélande				Pologne			
100 000 EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 1.125%, 20/03/25	97 041	0,03	100 000 EUR	ORLEN SA, 1.125%, 27/05/28	90 036	0,03
400 000 EUR	ASB Bank Ltd, 0.500%, 24/09/29	344 043	0,11	Pologne – Total			
Nouvelle-Zélande – Total						90 036	0,03
Norvège				Portugal			
100 000 EUR	Aker BP ASA, 1.125%, 12/05/29	88 813	0,03	200 000 EUR	Caixa Geral de Depositos SA, 5.750%, 31/10/28	215 173	0,07
500 000 EUR	DNB Bank ASA, 3.125%, 21/09/27	498 094	0,16	400 000 EUR	EDP - Energias de Portugal SA, 1.625%, 15/04/27	382 476	0,12
100 000 EUR	DNB Bank ASA, 4.500%, 19/07/28	103 346	0,03	200 000 EUR	EDP - Energias de Portugal SA, 3.875%, 26/06/28	205 497	0,07
100 000 EUR	DNB Bank ASA, 0.250%, 23/02/29	87 696	0,03	Portugal – Total			
100 000 EUR	DNB Bank ASA, 4.625%, 28/02/33	102 325	0,03			803 146	0,26
282 000 EUR	DNB Bank ASA, 5.000%, 13/09/33	293 471	0,10	Roumanie			
300 000 EUR	DNB Bank ASA, 4.000%, perpetual	309 027	0,10	100 000 EUR	Banca Comerciala Romana SA, 7.625%, perpetual	105 258	0,03
100 000 EUR	Equinor ASA, 2.875%, 10/09/25	99 493	0,03	Roumanie – Total			
200 000 EUR	Equinor ASA, 0.750%, 22/05/26	189 803	0,06			105 258	0,03
200 000 EUR	Equinor ASA, 1.250%, 17/02/27	189 371	0,06	Slovénie			
400 000 EUR	Equinor ASA, 1.625%, 17/02/35	337 535	0,11	100 000 EUR	Nova Ljubljanska Banka dd, 7.125%, 27/06/27	105 282	0,03
100 000 EUR	Norsk Hydro ASA, 1.125%, 11/04/25	96 603	0,03	Slovénie – Total			
100 000 EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 1.750%, 27/04/27	95 036	0,03			105 282	0,03
100 000 EUR	SpareBank 1 SMN, 0.125%, 11/09/26	91 927	0,03	Espagne			
140 000 EUR	SpareBank 1 SMN, 0.010%, 18/02/28	122 813	0,04	100 000 EUR	Abanca Corp Bancaria SA, 0.500%, 08/09/27	91 184	0,03
200 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.250%, 09/11/26	183 668	0,06	100 000 EUR	Abanca Corp Bancaria SA, 5.875%, 02/04/30	106 207	0,03
				200 000 EUR	Abanca Corp Bancaria SA, 5.500%, perpetual	203 041	0,07
				100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.500%, 27/02/25	98 451	0,03
				500 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.375%, 27/09/27	486 443	0,16
				200 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 4.125%, 31/01/28	205 564	0,07
				200 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.125%, 26/03/28	183 078	0,06
				400 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.625%, 15/07/29	362 823	0,12

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Espagne (suite)				Espagne (suite)			
100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 4.125%, 07/08/29	102 609	0,03	100 000 EUR	Banco Santander SA, 1.625%, 22/10/30	86 013	0,03
100 000 EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 0.375%, 07/10/27	89 574	0,03	300 000 EUR	Banco Santander SA, 4.875%, 18/10/31	319 266	0,10
100 000 EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 5.125%, 23/04/31	105 462	0,03	600 000 EUR	Banco Santander SA, 1.000%, 04/11/31	513 644	0,17
100 000 EUR	ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA, 1.875%, 20/04/26	96 664	0,03	200 000 EUR	Banco Santander SA, 5.750%, perpetual	209 564	0,07
100 000 EUR	Amadeus IT Group SA, 2.875%, 20/05/27	98 993	0,03	300 000 EUR	Bankinter SA, 0.875%, 08/07/26	281 883	0,09
200 000 EUR	Amadeus IT Group SA, 1.875%, 24/09/28	190 602	0,06	100 000 EUR	Bankinter SA, 0.625%, 06/10/27	90 937	0,03
200 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.375%, 14/05/25	193 910	0,06	100 000 EUR	Bankinter SA, 4.875%, 13/09/31	104 737	0,03
500 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.000%, 21/06/26	474 558	0,15	200 000 EUR	Bankinter SA, 1.250%, 23/12/32	178 069	0,06
200 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.500%, 14/01/27	184 412	0,06	200 000 EUR	CaixaBank SA, 1.125%, 27/03/26	190 324	0,06
100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.500%, 10/02/27	100 066	0,03	500 000 EUR	CaixaBank SA, 1.625%, 13/04/26	486 533	0,16
200 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.000%, 16/01/30	192 246	0,06	200 000 EUR	CaixaBank SA, 0.750%, 10/07/26	192 091	0,06
100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.625%, 13/01/31	104 905	0,03	400 000 EUR	CaixaBank SA, 0.375%, 18/11/26	376 354	0,12
200 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5.750%, 15/09/33	210 133	0,07	200 000 EUR	CaixaBank SA, 0.500%, 09/02/29	176 192	0,06
200 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.125%, perpetual	201 245	0,07	200 000 EUR	CaixaBank SA, 5.000%, 19/07/29	209 051	0,07
100 000 EUR	BanCo Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.375%, 20/09/27	100 873	0,03	500 000 EUR	CaixaBank SA, 4.250%, 06/09/30	518 950	0,17
500 000 EUR	BanCo Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.375%, 14/10/29	530 780	0,17	100 000 EUR	CaixaBank SA, 1.250%, 18/06/31	93 017	0,03
100 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 1.125%, 11/03/27	94 848	0,03	100 000 EUR	CaixaBank SA, 5.125%, 19/07/34	106 636	0,04
200 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 5.125%, 10/11/28	210 104	0,07	400 000 EUR	CaixaBank SA, 6.250%, 23/02/33	422 515	0,14
100 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 5.000%, 07/06/29	105 045	0,03	100 000 EUR	Criteria Caixa SA, 0.875%, 28/10/27	91 255	0,03
300 000 EUR	Banco Santander SA, 3.625%, 27/09/26	300 352	0,10	100 000 EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 4.125%, 04/04/29	104 002	0,03
400 000 EUR	Banco Santander SA, 3.125%, 19/01/27	396 071	0,13	100 000 EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 4.375%, 04/04/32	106 461	0,03
200 000 EUR	Banco Santander SA, 0.500%, 04/02/27	183 413	0,06	200 000 EUR	Enagas Financiaciones SA, 1.250%, 06/02/25	194 782	0,06
200 000 EUR	Banco Santander SA, 0.500%, 24/03/27	186 519	0,06	100 000 EUR	Enagas Financiaciones SA, 1.375%, 05/05/28	94 645	0,03
200 000 EUR	Banco Santander SA, 4.625%, 18/10/27	204 823	0,07	100 000 EUR	FCC Aqualia SA, 2.629%, 08/06/27	97 688	0,03
400 000 EUR	Banco Santander SA, 3.875%, 16/01/28	409 330	0,13	200 000 EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 1.661%, 04/12/26	190 489	0,06
300 000 EUR	Banco Santander SA, 2.125%, 08/02/28	283 969	0,09	100 000 EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 5.250%, 30/10/29	107 247	0,04
300 000 EUR	Banco Santander SA, 0.200%, 11/02/28	265 200	0,09	200 000 EUR	Ferrovial Emisiones SA, 1.382%, 14/05/26	192 457	0,06
200 000 EUR	Banco Santander SA, 0.625%, 24/06/29	176 922	0,06	200 000 EUR	Ferrovial Emisiones SA, 0.540%, 12/11/28	177 330	0,06
200 000 EUR	Banco Santander SA, 4.250%, 12/06/30	209 086	0,07	200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.000%, 07/03/25	194 266	0,06
				300 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.250%, 28/10/26	287 762	0,09
				300 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.250%, 13/09/27	286 033	0,09
				200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.125%, 22/11/28	202 622	0,07
				100 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.621%, 29/11/29	94 757	0,03
				200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.375%, 22/11/32	203 790	0,07
				100 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.625%, 13/07/33	103 531	0,03

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Espagne (suite)				Suède			
100 000 EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 1.625%, 28/11/25	96 637	0,03	200 000 EUR	Akelius Residential Property AB, 1.750%, 07/02/25	193 782	0,06
200 000 EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 2.000%, 17/04/26	193 356	0,06	100 000 EUR	Assa Abloy AB, 3.750%, 13/09/26	101 818	0,03
100 000 EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 1.350%, 14/10/28	92 110	0,03	100 000 EUR	Assa Abloy AB, 3.875%, 13/09/30	104 879	0,03
100 000 EUR	Kutxabank SA, 4.750%, 15/06/27	101 732	0,03	100 000 EUR	Assa Abloy AB, 4.125%, 13/09/35	109 548	0,04
100 000 EUR	Kutxabank SA, 4.000%, 01/02/28	101 139	0,03	100 000 EUR	Atlas Copco AB, 0.625%, 30/08/26	94 259	0,03
200 000 EUR	Mapfre SA, 4.375%, 31/03/47	196 609	0,06	100 000 EUR	Electrolux AB, 4.125%, 05/10/26	101 455	0,03
100 000 EUR	Mapfre SA, 4.125%, 07/09/48	96 089	0,03	200 000 EUR	EQT AB, 2.375%, 06/04/28	188 623	0,06
100 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 1.750%, 26/05/25	97 094	0,03	200 000 EUR	EQT AB, 2.875%, 06/04/32	177 873	0,06
200 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 1.875%, 02/11/26	192 344	0,06	200 000 EUR	Essity AB, 0.250%, 08/02/31	169 944	0,06
100 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 2.375%, 13/07/27	96 204	0,03	300 000 EUR	Fastighets AB Balder, 1.875%, 23/01/26	273 416	0,09
100 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 1.375%, 01/06/30	84 679	0,03	200 000 EUR	Hemso Fastighets AB, 1.000%, 09/09/26	185 082	0,06
100 000 EUR	NorteGas Energia Distribucion SA, 0.905%, 22/01/31	79 623	0,03	300 000 EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.125%, 19/02/25	287 684	0,09
200 000 EUR	Prosegur Cash SA, 1.375%, 04/02/26	191 346	0,06	100 000 EUR	Lansforsakringar Bank AB, 4.000%, perpetual	101 559	0,03
200 000 EUR	Prosegur Cia de Seguridad SA, 2.500%, 06/04/29	190 337	0,06	700 000 EUR	Nordea Bank Abp, 1.125%, 12/02/25	681 983	0,22
100 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.125%, 24/04/25	97 207	0,03	300 000 EUR	Sandvik AB, 3.750%, 27/09/29	309 756	0,10
200 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.250%, 13/03/27	190 508	0,06	200 000 EUR	SbAB Bank AB, 1.875%, perpetual	194 226	0,06
200 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.500%, 24/05/33	163 644	0,05	100 000 EUR	SBAB Bank AB, 0.500%, 13/05/25	95 889	0,03
100 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.010%, 23/02/26	93 255	0,03	100 000 EUR	SBAB Bank AB, 4.875%, 26/06/26	100 985	0,03
200 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.500%, 14/01/27	183 816	0,06	100 000 EUR	SBAB Bank AB, 0.125%, 27/08/26	92 409	0,03
300 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.201%, 21/08/27	279 985	0,09	200 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.250%, 24/11/25	200 079	0,07
400 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.715%, 12/01/28	378 224	0,12	500 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.000%, 09/11/26	508 040	0,16
100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.318%, 17/10/28	96 362	0,03	200 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1.750%, 11/11/26	191 870	0,06
100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.788%, 12/03/29	94 110	0,03	200 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.125%, 29/06/27	205 888	0,07
400 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.932%, 17/10/29	395 658	0,13	200 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.750%, 09/08/27	181 782	0,06
200 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.930%, 17/10/31	182 430	0,06	100 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.750%, 07/02/28	101 006	0,03
200 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 4.183%, 21/11/33	210 038	0,07	200 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.750%, 03/11/31	182 091	0,06
125 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.957%, 01/07/39	100 063	0,03	200 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.000%, 15/04/25	193 974	0,06
300 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.864%, 13/07/40	233 937	0,08	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.875%, 10/05/27	102 024	0,03
200 000 EUR	Unicaja Banco SA, 1.000%, 01/12/26	188 768	0,06	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.750%, 01/11/27	102 518	0,03
100 000 EUR	Werfen SA/Spain, 4.625%, 06/06/28	101 843	0,03	200 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.375%, 17/02/28	201 751	0,07
Espagne – Total				19 823 545 6,39			

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Suède (suite)				Royaume-Uni (suite)			
200 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 5.000%, 16/08/34	209 673	0,07	150 000 EUR	Barclays PLC, 2.885%, 31/01/27	147 525	0,05
400 000 EUR	Swedbank AB, 0.250%, 02/11/26	368 936	0,12	500 000 EUR	Barclays PLC, 0.577%, 09/08/29	429 994	0,14
500 000 EUR	Swedbank AB, 2.100%, 25/05/27	481 179	0,16	200 000 EUR	Barclays PLC, 4.918%, 08/08/30	208 160	0,07
200 000 EUR	Swedbank AB, 0.200%, 12/01/28	174 252	0,06	200 000 EUR	Barclays PLC, 5.262%, 29/01/34	213 859	0,07
400 000 EUR	Swedbank AB, 4.250%, 11/07/28	410 742	0,13	400 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 2.972%, 27/02/26	397 133	0,13
100 000 EUR	Swedbank AB, 4.375%, 05/09/30	103 601	0,03	400 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.637%, 26/06/29	371 119	0,12
200 000 EUR	Tele2 AB, 2.125%, 15/05/28	191 273	0,06	200 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.231%, 08/05/31	174 431	0,06
200 000 EUR	Telia Co AB, 3.875%, 01/10/25	202 163	0,07	200 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 2.822%, 07/04/32	194 333	0,06
100 000 EUR	Telia Co AB, 3.000%, 07/09/27	100 279	0,03	200 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.104%, 15/11/34	157 597	0,05
100 000 EUR	Telia Co AB, 3.625%, 22/02/32	103 397	0,03	400 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 3.250%, perpetual	385 765	0,13
100 000 EUR	Telia Co AB, 1.625%, 23/02/35	84 288	0,03	200 000 EUR	British Telecommunications PLC, 0.500%, 12/09/25	190 402	0,06
300 000 EUR	Telia Co AB, 1.375%, 11/05/81	278 250	0,09	200 000 EUR	British Telecommunications PLC, 1.750%, 10/03/26	193 797	0,06
200 000 EUR	Vattenfall AB, 0.500%, 24/06/26	187 733	0,06	365 000 EUR	British Telecommunications PLC, 2.125%, 26/09/28	349 547	0,11
200 000 EUR	Vattenfall AB, 3.000%, 19/03/77	188 812	0,06	100 000 EUR	British Telecommunications PLC, 1.125%, 12/09/29	89 545	0,03
Suède – Total		9 545 577	3,08	100 000 EUR	British Telecommunications PLC, 4.250%, 06/01/33	105 251	0,03
Suisse				100 000 EUR	British Telecommunications PLC, 2.750%, 30/08/27	98 756	0,03
100 000 EUR	Zuercher Kantonalbank, 4.467%, 15/09/27	102 379	0,03	100 000 EUR	British Telecommunications PLC, 3.375%, 30/08/32	99 842	0,03
Suisse – Total		102 379	0,03	100 000 EUR	Cadent Finance PLC, 0.625%, 19/03/30	84 180	0,03
Émirats arabes unis				200 000 EUR	Cadent Finance PLC, 0.750%, 11/03/32	161 291	0,05
200 000 EUR	Emirates Telecommunications Group Co PJSC, 2.750%, 18/06/26	194 864	0,06	100 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1.500%, 08/11/27	94 440	0,03
200 000 EUR	Emirates Telecommunications Group Co PJSC, 0.375%, 17/05/28	175 407	0,06	200 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 0.200%, 02/12/28	174 464	0,06
200 000 EUR	First Abu Dhabi Bank PJSC, 0.125%, 16/02/26	184 442	0,06	300 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1.125%, 12/04/29	271 960	0,09
Émirats arabes unis – Total		554 713	0,18	300 000 EUR	Diageo Finance PLC, 1.875%, 27/03/27	290 176	0,09
Royaume-Uni				100 000 EUR	Diageo Finance PLC, 1.500%, 22/10/27	94 889	0,03
100 000 EUR	3i Group PLC, 4.875%, 14/06/29	104 365	0,03	200 000 EUR	Diageo Finance PLC, 2.500%, 27/03/32	191 750	0,06
100 000 EUR	Ancor UK Finance PLC, 1.125%, 23/06/27	92 983	0,03	100 000 EUR	DS Smith PLC, 0.875%, 12/09/26	93 282	0,03
100 000 EUR	Anglo American Capital PLC, 1.625%, 18/09/25	97 005	0,03	100 000 EUR	DS Smith PLC, 4.375%, 27/07/27	102 848	0,03
100 000 EUR	Anglo American Capital PLC, 1.625%, 11/03/26	96 125	0,03	200 000 EUR	DS Smith PLC, 4.500%, 27/07/30	208 151	0,07
100 000 EUR	Anglo American Capital PLC, 4.500%, 15/09/28	103 839	0,03	300 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 4.000%, 16/06/25	302 520	0,10
200 000 EUR	Anglo American Capital PLC, 5.000%, 15/03/31	212 868	0,07	200 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.250%, 21/05/26	192 347	0,06
110 000 EUR	Anglo American Capital PLC, 4.750%, 21/09/32	115 439	0,04	173 000 EUR	GSK Capital BV, 3.000%, 28/11/27	174 244	0,06
200 000 EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.200%, 23/09/27	178 809	0,06	200 000 EUR	GSK Capital BV, 3.125%, 28/11/32	202 038	0,06
100 000 EUR	Aon Global Ltd, 2.875%, 14/05/26	98 281	0,03	550 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.000%, 30/06/25	544 022	0,18
200 000 EUR	AstraZeneca PLC, 1.250%, 12/05/28	188 000	0,06				
200 000 EUR	AstraZeneca PLC, 0.375%, 03/06/29	175 819	0,06				
100 000 EUR	AstraZeneca PLC, 3.750%, perpetual	105 133	0,03				
209 000 EUR	Aviva PLC, 3.375%, 04/12/45	203 586	0,07				
400 000 EUR	Barclays PLC, 1.375%, 24/01/26	388 180	0,13				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
700 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.019%, 15/06/27	691 243	0,22	210 000 EUR	Nationwide Building Society, 3.250%, 05/09/29	209 378	0,07
200 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.752%, 10/03/28	207 389	0,07	190 000 EUR	Natwest Group PLC, 0.780%, 26/02/30	163 515	0,05
200 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.125%, 07/06/28	196 254	0,06	500 000 EUR	NatWest Group PLC, 1.750%, 02/03/26	486 752	0,16
300 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 0.770%, 13/11/31	250 983	0,08	104 000 EUR	NatWest Group PLC, 4.699%, 14/03/28	107 002	0,04
100 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.787%, 10/03/32	105 688	0,03	200 000 EUR	NatWest Markets PLC, 2.750%, 02/04/25	198 058	0,06
100 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.856%, perpetual	106 072	0,03	200 000 EUR	NatWest Markets PLC, 2.000%, 27/08/25	194 978	0,06
100 000 EUR	Informa PLC, 2.125%, 06/10/25	97 120	0,03	195 000 EUR	NatWest Markets PLC, 0.125%, 12/11/25	183 674	0,06
100 000 EUR	International Distributions Services PLC, 5.250%, 14/09/28	103 650	0,03	200 000 EUR	NatWest Markets PLC, 0.125%, 18/06/26	185 239	0,06
100 000 EUR	ITV PLC, 1.375%, 26/09/26	94 011	0,03	300 000 EUR	NatWest Markets PLC, 1.375%, 02/03/27	282 315	0,09
300 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 3.500%, 01/04/26	298 993	0,10	200 000 EUR	Omnicom Finance Holdings PLC, 1.400%, 08/07/31	178 899	0,06
400 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 4.500%, 11/01/29	415 056	0,13	100 000 EUR	Phoenix Group Holdings PLC, 4.375%, 24/01/29	95 201	0,03
300 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 3.125%, 24/08/30	291 965	0,09	100 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3.625%, 14/09/28	103 391	0,03
300 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 4.750%, 21/09/31	316 829	0,10	100 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3.875%, 14/09/33	105 765	0,03
300 000 EUR	London Stock Exchange Group PLC, 1.750%, 06/12/27	287 043	0,09	100 000 EUR	Rentokil Initial PLC, 0.875%, 30/05/26	94 526	0,03
200 000 EUR	London Stock Exchange Group PLC, 1.750%, 19/09/29	186 658	0,06	100 000 EUR	Rentokil Initial PLC, 0.500%, 14/10/28	88 445	0,03
100 000 EUR	Mobico Group PLC, 4.875%, 26/09/31	101 077	0,03	100 000 EUR	Sage Group PLC, 3.820%, perpetual	102 771	0,03
100 000 EUR	Mondi Finance PLC, 1.625%, 27/04/26	96 496	0,03	100 000 EUR	Santander UK Group Holdings PLC, 3.530%, 25/08/28	99 189	0,03
100 000 EUR	Motability Operations Group PLC, 0.375%, 03/01/26	94 550	0,03	300 000 EUR	Sky Ltd, 2.250%, 17/11/25	294 859	0,10
100 000 EUR	Motability Operations Group PLC, 0.125%, 20/07/28	87 934	0,03	100 000 EUR	SSE PLC, 1.375%, 04/09/27	94 471	0,03
100 000 EUR	Motability Operations Group PLC, 3.500%, 17/07/31	102 429	0,03	61 000 EUR	SSE PLC, 2.875%, 01/08/29	60 283	0,02
100 000 EUR	National Gas Transmission PLC, 4.250%, 05/04/30	103 671	0,03	100 000 EUR	SSE PLC, 1.750%, 16/04/30	91 719	0,03
200 000 EUR	National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3.530%, 20/09/28	202 947	0,07	300 000 EUR	SSE PLC, 4.000%, 05/09/31	313 265	0,10
115 000 EUR	National Grid Electricity Transmission PLC, 0.823%, 07/07/32	93 207	0,03	300 000 EUR	SSE PLC, 4.000%, perpetual	289 642	0,09
350 000 EUR	National Grid PLC, 2.179%, 30/06/26	340 172	0,11	179 000 EUR	Standard Chartered PLC, 1.625%, 03/10/27	169 519	0,06
200 000 EUR	National Grid PLC, 0.553%, 18/09/29	171 845	0,06	100 000 EUR	Standard Chartered PLC, 0.800%, 17/11/29	86 891	0,03
80 000 EUR	National Grid PLC, 2.949%, 30/03/30	77 860	0,03	225 000 EUR	Standard Chartered PLC, 2.500%, 09/09/30	217 647	0,07
215 000 EUR	National Grid PLC, 3.245%, 30/03/34	204 259	0,07	200 000 EUR	Standard Chartered PLC, 4.874%, perpetual	209 328	0,07
500 000 EUR	Nationwide Building Society, 0.250%, 22/07/25	475 692	0,15	100 000 EUR	Swiss Re Finance Uk PLC, 2.714%, 04/06/52	88 580	0,03
100 000 EUR	Nationwide Building Society, 0.250%, 14/09/28	87 182	0,03	200 000 EUR	Tesco Corporate Treasury Services PLC, 0.875%, 29/05/26	189 204	0,06
				200 000 EUR	Tesco Corporate Treasury Services PLC, 4.250%, perpetual	207 683	0,07
				100 000 EUR	Thames Water Utilities Finance PLC, 4.000%, 18/04/27	96 557	0,03

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 EUR	Thames Water Utilities Finance PLC, 0.875%, 31/01/28	85 251	0,03	100 000 EUR	AT&T Inc, 3.375%, 15/03/34	97 824	0,03
100 000 EUR	Thames Water Utilities Finance PLC, 1.250%, 31/01/32	75 063	0,02	400 000 EUR	AT&T Inc, 2.450%, 15/03/35	355 531	0,12
300 000 EUR	Unilever PLC, 1.500%, 11/06/39	243 176	0,08	300 000 EUR	AT&T Inc, 3.150%, 04/09/36	279 282	0,09
200 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.125%, 20/11/25	192 407	0,06	300 000 EUR	AT&T Inc, 1.800%, 14/09/39	228 012	0,07
500 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.200%, 25/08/26	490 028	0,16	100 000 EUR	AT&T Inc, 3.550%, perpetual	100 502	0,03
150 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.625%, 24/11/30	135 938	0,04	400 000 EUR	Athene Global Funding, 0.625%, 12/01/28	355 563	0,12
400 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.875%, 20/11/37	369 108	0,12	100 000 EUR	Avery Dennison Corp, 1.250%, 03/03/25	96 955	0,03
200 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.500%, 24/05/39	174 315	0,06	100 000 EUR	Baxter International Inc, 1.300%, 30/05/25	96 549	0,03
305 000 EUR	Yorkshire Building Society, 0.500%, 01/07/28	266 528	0,09	200 000 EUR	Baxter International Inc, 1.300%, 15/05/29	179 294	0,06
Royaume-Uni – Total		22 358 925	7,21	200 000 EUR	Becton Dickinson & Co, 1.900%, 15/12/26	193 053	0,06
États-Unis				100 000 EUR	Berry Global Inc, 1.000%, 15/01/25	96 853	0,03
100 000 EUR	AbbVie Inc, 0.750%, 18/11/27	92 169	0,03	300 000 EUR	BMW US Capital LLC, 1.000%, 20/04/27	282 638	0,09
200 000 EUR	AbbVie Inc, 2.125%, 17/11/28	192 462	0,06	175 000 EUR	Booking Holdings Inc, 0.100%, 08/03/25	168 159	0,05
100 000 EUR	AbbVie Inc, 2.125%, 01/06/29	95 400	0,03	300 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.000%, 15/11/26	308 022	0,10
200 000 EUR	AbbVie Inc, 1.250%, 18/11/31	174 141	0,06	200 000 EUR	Booking Holdings Inc, 1.800%, 03/03/27	192 310	0,06
100 000 EUR	Air Products and Chemicals Inc, 0.800%, 05/05/32	82 915	0,03	105 000 EUR	Booking Holdings Inc, 0.500%, 08/03/28	95 123	0,03
100 000 EUR	Air Products and Chemicals Inc, 4.000%, 03/03/35	105 362	0,03	122 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.250%, 15/05/29	129 036	0,04
100 000 EUR	American Tower Corp, 1.375%, 04/04/25	96 994	0,03	111 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.500%, 15/11/31	120 690	0,04
100 000 EUR	American Tower Corp, 0.400%, 15/02/27	91 069	0,03	200 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.750%, 15/11/34	225 310	0,07
100 000 EUR	American Tower Corp, 0.500%, 15/01/28	89 091	0,03	200 000 EUR	Booking Holdings Inc, 3.625%, perpetual	205 481	0,07
300 000 EUR	American Tower Corp, 0.875%, 21/05/29	261 181	0,08	200 000 EUR	BorgWarner Inc, 1.000%, 19/05/31	164 416	0,05
170 000 EUR	American Tower Corp, 1.000%, 15/01/32	138 995	0,05	100 000 EUR	Bristol-Myers Squibb Co, 1.000%, 15/05/25	96 965	0,03
300 000 EUR	American Tower Corp, 1.250%, 21/05/33	241 177	0,08	400 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 1.550%, 15/03/28	376 986	0,12
200 000 EUR	Amgen Inc, 2.000%, 25/02/26	195 202	0,06	175 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 0.875%, 15/12/29	154 827	0,05
200 000 EUR	Apple Inc, 0.875%, 24/05/25	193 649	0,06	200 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 2.500%, 15/03/38	175 125	0,06
100 000 EUR	Apple Inc, 0.010%, 15/11/25	94 770	0,03	100 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.125%, 09/03/27	94 203	0,03
200 000 EUR	Apple Inc, 1.625%, 10/11/26	194 127	0,06	280 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.125%, 09/03/29	243 636	0,08
200 000 EUR	Apple Inc, 2.000%, 17/09/27	195 594	0,06	455 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.400%, 06/05/30	390 308	0,13
300 000 EUR	Apple Inc, 1.375%, 24/05/29	281 624	0,09	100 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.250%, 08/03/31	89 485	0,03
200 000 EUR	Apple Inc, 0.500%, 15/11/31	170 384	0,06	100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.500%, 09/03/33	80 292	0,03
200 000 EUR	Archer-Daniels-Midland Co, 1.000%, 12/09/25	192 585	0,06	200 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.375%, 15/03/33	158 973	0,05
300 000 EUR	AT&T Inc, 3.550%, 18/11/25	301 505	0,10	400 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.625%, 09/03/35	345 591	0,11
300 000 EUR	AT&T Inc, 3.500%, 17/12/25	300 532	0,10	300 000 EUR	Colgate-Palmolive Co, 0.500%, 06/03/26	285 177	0,09
200 000 EUR	AT&T Inc, 1.800%, 05/09/26	193 030	0,06	100 000 EUR	Colgate-Palmolive Co, 1.375%, 06/03/34	87 393	0,03
300 000 EUR	AT&T Inc, 1.600%, 19/05/28	281 526	0,09	330 000 EUR	Comcast Corp, 0.010%, 14/09/26	304 335	0,10
300 000 EUR	AT&T Inc, 2.350%, 05/09/29	287 498	0,09				
200 000 EUR	AT&T Inc, 0.800%, 04/03/30	173 733	0,06				
200 000 EUR	AT&T Inc, 3.550%, 17/12/32	200 471	0,07				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 EUR	Comcast Corp, 0.250%, 20/05/27	91 639	0,03	165 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 4.000%, 21/09/29	170 173	0,06
70 000 EUR	Comcast Corp, 0.250%, 14/09/29	60 458	0,02	200 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.875%, 21/01/30	172 042	0,06
100 000 EUR	Corning Inc, 4.125%, perpetual	104 542	0,03	300 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 3.000%, 12/02/31	294 826	0,10
200 000 EUR	Digital Euro Finco LLC, 2.500%, 16/01/26	194 621	0,06	200 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.750%, 23/03/32	159 675	0,05
100 000 EUR	Digital Euro Finco LLC, 1.125%, 09/04/28	90 390	0,03	200 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.950%, 23/05/25	193 358	0,06
100 000 EUR	Discovery Communications LLC, 1.900%, 19/03/27	95 060	0,03	400 000 EUR	International Business Machines Corp, 3.375%, 06/02/27	404 686	0,13
200 000 EUR	Dover Corp, 0.750%, 04/11/27	182 992	0,06	200 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.300%, 11/02/28	180 106	0,06
100 000 EUR	Dow Chemical Co, 0.500%, 15/03/27	91 487	0,03	200 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.750%, 07/03/28	191 338	0,06
200 000 EUR	Dow Chemical Co, 1.125%, 15/03/32	166 315	0,05	300 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.500%, 23/05/29	279 179	0,09
100 000 EUR	Duke Energy Corp, 3.100%, 15/06/28	98 517	0,03	200 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.875%, 09/02/30	176 742	0,06
100 000 EUR	Duke Energy Corp, 3.850%, 15/06/34	98 791	0,03	200 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.750%, 31/01/31	183 341	0,06
200 000 EUR	DXC Technology Co, 1.750%, 15/01/26	192 876	0,06	200 000 EUR	International Business Machines Corp, 3.625%, 06/02/31	206 165	0,07
200 000 EUR	Eli Lilly & Co, 0.500%, 14/09/33	162 727	0,05	100 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.650%, 11/02/32	82 631	0,03
700 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.375%, 14/09/61	436 670	0,14	100 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.250%, 09/02/34	83 558	0,03
100 000 EUR	Equinix Inc, 1.000%, 15/03/33	80 679	0,03	200 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.250%, 09/02/34	167 303	0,05
190 000 EUR	FedEx Corp, 0.450%, 04/05/29	164 849	0,05	100 000 EUR	International Business Machines Corp, 3.750%, 06/02/35	104 286	0,03
100 000 EUR	FedEx Corp, 1.300%, 05/08/31	88 166	0,03	100 000 EUR	International Business Machines Corp, 4.000%, 06/02/43	103 868	0,03
180 000 EUR	FedEx Corp, 0.950%, 04/05/33	141 750	0,05	100 000 EUR	International Flavors & Fragrances Inc, 1.800%, 25/09/26	94 848	0,03
100 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 0.625%, 03/12/25	94 973	0,03	130 000 EUR	Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA, 3.000%, 15/09/28	129 273	0,04
200 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 2.000%, 21/05/30	185 413	0,06	100 000 EUR	Kellanova, 1.250%, 10/03/25	97 404	0,03
100 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 2.950%, 21/05/39	87 549	0,03	100 000 EUR	Kinder Morgan Inc, 2.250%, 16/03/27	96 015	0,03
100 000 EUR	Fiserv Inc, 1.625%, 01/07/30	90 284	0,03	200 000 EUR	Linde Inc/CT, 1.625%, 01/12/25	194 046	0,06
200 000 EUR	Fiserv Inc, 4.500%, perpetual	211 876	0,07	200 000 EUR	ManpowerGroup Inc, 1.750%, 22/06/26	193 275	0,06
90 000 EUR	General Mills Inc, 0.125%, 15/11/25	84 939	0,03	200 000 EUR	Marsh & McLennan Cos Inc, 1.979%, 21/03/30	188 103	0,06
150 000 EUR	General Mills Inc, 0.450%, 15/01/26	141 459	0,05	100 000 EUR	McDonald's Corp, 1.875%, 26/05/27	96 112	0,03
300 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 0.850%, 26/02/26	284 534	0,09	100 000 EUR	McDonald's Corp, 3.625%, 28/11/27	102 091	0,03
100 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 0.600%, 20/05/27	91 290	0,03	200 000 EUR	McDonald's Corp, 1.750%, 03/05/28	189 696	0,06
200 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 4.300%, 15/02/29	205 839	0,07	100 000 EUR	McDonald's Corp, 0.250%, 04/10/28	88 102	0,03
300 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 3.375%, 27/03/25	299 286	0,10	100 000 EUR	McDonald's Corp, 2.375%, 31/05/29	96 854	0,03
300 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 2.875%, 03/06/26	297 250	0,10				
300 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.625%, 27/07/26	288 257	0,09				
200 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 2.000%, 22/03/28	190 736	0,06				
400 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 2.000%, 01/11/28	378 077	0,12				
205 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.875%, 09/05/29	178 106	0,06				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 EUR	McDonald's Corp, 1.500%, 28/11/29	91 371	0,03	200 000 EUR	Netflix Inc, 3.625%, 15/06/30	203 414	0,07
100 000 EUR	McDonald's Corp, 4.000%, 07/03/30	104 620	0,03	200 000 EUR	New York Life Global Funding, 0.250%, 23/01/27	180 851	0,06
100 000 EUR	McDonald's Corp, 3.875%, 20/02/31	103 817	0,03	200 000 EUR	New York Life Global Funding, 3.625%, 09/01/30	205 724	0,07
100 000 EUR	McDonald's Corp, 1.600%, 15/03/31	89 870	0,03	300 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.875%, 18/07/28	275 797	0,09
15 000 EUR	McDonald's Corp, 3.000%, 31/05/34	14 529	0,01	200 000 EUR	PepsiCo Inc, 1.125%, 18/03/31	178 090	0,06
100 000 EUR	McKesson Corp, 1.625%, 30/10/26	96 240	0,03	250 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.400%, 09/10/32	201 702	0,07
300 000 EUR	Merck & Co Inc, 1.875%, 15/10/26	291 612	0,09	220 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.750%, 14/10/33	179 754	0,06
200 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 1.750%, 25/05/25	195 211	0,06	100 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.875%, 16/10/39	72 472	0,02
300 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 4.000%, 05/04/28	309 382	0,10	50 000 EUR	PepsiCo Inc, 1.050%, 09/10/50	32 444	0,01
100 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.500%, 25/05/29	86 909	0,03	200 000 EUR	PPG Industries Inc, 1.400%, 13/03/27	188 407	0,06
100 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 0.625%, 13/06/25	95 786	0,03	100 000 EUR	PPG Industries Inc, 2.750%, 01/06/29	97 625	0,03
400 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 1.750%, 13/06/31	361 336	0,12	100 000 EUR	Procter & Gamble Co, 4.875%, 11/05/27	106 329	0,03
200 000 EUR	Mondelez International Inc, 0.250%, 17/03/28	178 690	0,06	300 000 EUR	Procter & Gamble Co, 1.200%, 30/10/28	279 597	0,09
55 000 EUR	Mondelez International Inc, 0.750%, 17/03/33	44 405	0,01	100 000 EUR	Procter & Gamble Co, 1.250%, 25/10/29	92 208	0,03
300 000 EUR	Mondelez International Inc, 1.375%, 17/03/41	219 338	0,07	200 000 EUR	Procter & Gamble Co, 3.250%, 02/08/31	206 058	0,07
200 000 EUR	Moody's Corp, 1.750%, 09/03/27	192 330	0,06	100 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.875%, 05/01/29	92 863	0,03
175 000 EUR	Moody's Corp, 0.950%, 25/02/30	154 714	0,05	100 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 3.875%, 31/01/30	101 756	0,03
200 000 EUR	Morgan Stanley, 2.103%, 08/05/26	195 438	0,06	200 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 0.625%, 10/09/31	163 217	0,05
200 000 EUR	Morgan Stanley, 1.342%, 23/10/26	191 865	0,06	385 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 0.500%, 16/02/32	301 286	0,10
200 000 EUR	Morgan Stanley, 1.375%, 27/10/26	189 969	0,06	275 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.000%, 06/02/35	184 787	0,06
300 000 EUR	Morgan Stanley, 1.875%, 27/04/27	285 975	0,09	193 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 4.625%, perpetual	205 918	0,07
500 000 EUR	Morgan Stanley, 0.406%, 29/10/27	458 886	0,15	200 000 EUR	Public Storage Operating Co, 0.875%, 24/01/32	165 210	0,05
200 000 EUR	Morgan Stanley, 4.813%, 25/10/28	209 280	0,07	300 000 EUR	RELX Capital Inc, 1.300%, 12/05/25	291 252	0,09
300 000 EUR	Morgan Stanley, 4.656%, 02/03/29	311 396	0,10	100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 3.200%, 21/01/26	100 189	0,03
300 000 EUR	Morgan Stanley, 0.495%, 26/10/29	258 794	0,08	400 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 0.500%, 01/03/28	363 372	0,12
300 000 EUR	Morgan Stanley, 0.497%, 07/02/31	248 437	0,08	300 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.375%, 12/09/28	280 099	0,09
300 000 EUR	Morgan Stanley, 2.950%, 07/05/32	283 131	0,09	500 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.950%, 24/07/29	474 285	0,15
200 000 EUR	Morgan Stanley, 1.102%, 29/04/33	162 220	0,05	200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 2.375%, 15/04/32	189 545	0,06
300 000 EUR	Morgan Stanley, 5.148%, 25/01/34	328 956	0,11	174 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 3.650%, 21/11/34	180 916	0,06
100 000 EUR	Nasdaq Inc, 1.750%, 28/03/29	92 747	0,03	100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 2.875%, 24/07/37	94 539	0,03
195 000 EUR	Nasdaq Inc, 0.875%, 13/02/30	169 077	0,05	200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.875%, 01/10/49	142 708	0,05
200 000 EUR	Nasdaq Inc, 4.500%, 15/02/32	213 881	0,07	100 000 EUR	Unilever Capital Corp, 3.300%, 06/06/29	102 196	0,03
100 000 EUR	National Grid North America Inc, 4.151%, 12/09/27	102 666	0,03				
100 000 EUR	National Grid North America Inc, 1.054%, 20/01/31	84 455	0,03				
100 000 EUR	National Grid North America Inc, 4.668%, 12/09/33	106 658	0,03				
200 000 EUR	Netflix Inc, 3.625%, 15/05/27	202 355	0,07				
100 000 EUR	Netflix Inc, 4.625%, 15/05/29	106 698	0,03				
200 000 EUR	Netflix Inc, 3.875%, 15/11/29	206 611	0,07				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,15 % (suite)			
États-Unis (suite)				Allemagne			
200 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.625%, 15/11/25	194 543	0,06	200 000 EUR	GEWO BAG Wohnungsbau-AG Berlin, 0.125%, 24/06/27	178 476	0,06
100 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.000%, 15/11/28	91 912	0,03	Allemagne – Total			178 476 0,06
200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.875%, 02/04/25	193 682	0,06	Total des obligations d'État			1 109 369 0,36
400 000 EUR	Verizon Communications Inc, 3.250%, 17/02/26	400 874	0,14	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			305 446 812 98,51
200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.875%, 08/04/27	186 832	0,06	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			305 446 812 98,51
200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.375%, 02/11/28	185 228	0,06	Autres actifs/(passifs) nets			4 625 608 1,49
200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.375%, 22/03/29	173 729	0,06	TOTAL DES ACTIFS NETS			310 072 420 100,00
200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.250%, 08/04/30	177 997	0,06				
400 000 EUR	Verizon Communications Inc, 4.250%, 31/10/30	423 596	0,14				
100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 2.625%, 01/12/31	95 480	0,03				
200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.875%, 19/03/32	165 363	0,05				
200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 4.750%, 31/10/34	221 374	0,07				
200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 2.875%, 15/01/38	184 280	0,06				
200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.500%, 19/09/39	149 712	0,05				
200 000 EUR	VF Corp, 4.125%, 07/03/26	197 734	0,06				
400 000 EUR	VF Corp, 0.250%, perpetual	335 564	0,11				
200 000 EUR	Visa Inc, 1.500%, 15/06/26	193 169	0,06				
100 000 EUR	Worley US Finance Sub Ltd, 0.875%, 09/06/26	93 326	0,03				
200 000 EUR	Zimmer Biomet Holdings Inc, 1.164%, 15/11/27	185 274	0,06				
États-Unis – Total		38 966 512	12,57				
Total des obligations d'entreprise		304 337 443	98,15				
Obligations d'État – 0,36 %							
Canada							
200 000 EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.500%, 06/05/25	192 738	0,06				
200 000 EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.100%, 19/05/28	177 832	0,06				
100 000 EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 3.300%, 05/10/29	101 922	0,03				
100 000 EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.050%, 25/11/30	81 899	0,03				
200 000 EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 1.850%, 03/05/32	182 467	0,06				
200 000 EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.900%, 20/05/41	137 903	0,04				
100 000 EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.950%, 24/11/51	56 132	0,02				
Canada – Total		930 893	0,30				

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Obligations d'État – 98,40 %				Obligations d'État – 98,40 % (<i>suite</i>)			
Australie				Autriche			
1 699 000 AUD	Australia Government Bond, 3.250%, 21/04/25	1 150 386	0,06	650 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/04/25	693 315	0,03
2 250 000 AUD	Australia Government Bond, 0.250%, 21/11/25	1 439 593	0,07	851 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.200%, 20/10/25	919 846	0,05
1 769 000 AUD	Australia Government Bond, 4.250%, 21/04/26	1 223 034	0,06	516 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 4.850%, 15/03/26	599 292	0,03
2 600 000 AUD	Australia Government Bond, 0.500%, 21/09/26	1 632 695	0,08	500 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.000%, 15/07/26	547 807	0,03
1 524 000 AUD	Australia Government Bond, 4.750%, 21/04/27	1 076 630	0,05	824 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/10/26	871 538	0,04
1 967 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/11/27	1 300 668	0,06	516 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.500%, 20/04/27	538 108	0,03
2 116 000 AUD	Australia Government Bond, 2.250%, 21/05/28	1 364 397	0,07	263 289 EUR	Republic of Austria Government Bond, 6.250%, 15/07/27	329 446	0,02
2 109 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/11/28	1 382 362	0,07	731 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/02/28	758 920	0,04
1 499 000 AUD	Australia Government Bond, 3.250%, 21/04/29	1 002 038	0,05	550 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/10/28	544 469	0,03
1 851 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/11/29	1 198 893	0,06	722 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.500%, 20/02/29	728 425	0,04
2 122 000 AUD	Australia Government Bond, 2.500%, 21/05/30	1 345 461	0,07	400 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.900%, 23/05/29	455 513	0,02
2 050 000 AUD	Australia Government Bond, 1.000%, 21/12/30	1 160 794	0,06	700 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/02/30	669 523	0,03
2 200 000 AUD	Australia Government Bond, 1.500%, 21/06/31	1 275 168	0,06	500 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.450%, 20/10/30	586 691	0,03
2 150 000 AUD	Australia Government Bond, 1.000%, 21/11/31	1 183 207	0,06	900 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/02/31	836 378	0,04
2 350 000 AUD	Australia Government Bond, 1.250%, 21/05/32	1 302 172	0,07	700 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.900%, 20/02/32	680 542	0,03
1 700 000 AUD	Australia Government Bond, 1.750%, 21/11/32	971 797	0,05	900 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.900%, 20/02/33	1 019 815	0,05
1 477 000 AUD	Australia Government Bond, 4.500%, 21/04/33	1 051 288	0,05	420 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.400%, 23/05/34	454 743	0,02
1 300 000 AUD	Australia Government Bond, 3.000%, 21/11/33	818 148	0,04	475 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.250%, 20/10/36	385 273	0,02
2 000 000 AUD	Australia Government Bond, 3.750%, 21/05/34	1 339 589	0,07	699 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 4.150%, 15/03/37	886 529	0,04
1 500 000 AUD	Australia Government Bond, 3.500%, 21/12/34	979 697	0,05	400 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/10/40	276 967	0,01
534 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/06/35	322 534	0,02	590 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.150%, 20/06/44	681 059	0,03
1 018 000 AUD	Australia Government Bond, 3.750%, 21/04/37	671 126	0,03	595 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.500%, 20/02/47	505 583	0,03
651 000 AUD	Australia Government Bond, 3.250%, 21/06/39	397 657	0,02	800 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.850%, 23/05/49	723 228	0,04
801 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/05/41	446 465	0,02	200 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/03/51	134 677	0,01
697 000 AUD	Australia Government Bond, 3.000%, 21/03/47	384 017	0,02	200 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.150%, 20/10/53	231 325	0,01
1 050 000 AUD	Australia Government Bond, 1.750%, 21/06/51	422 988	0,02	316 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.800%, 26/01/62	419 218	0,02
500 000 AUD	Australia Government Bond, 4.750%, 21/06/54	367 633	0,02	175 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.700%, 20/04/71	92 443	0,00
Australie – Total		27 210 437	1,36	128 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.500%, 02/11/86	89 577	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Autriche (suite)				Belgique (suite)			
340 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.100%, 20/09/17			584 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.700%, 22/06/50	481 089 0,02	
250 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.850%, 30/06/20	131 000	0,01	600 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.400%, 22/06/53	444 646	0,02
Autriche – Total				Belgique – Total			
16 087 031				24 090 581			
0,80				1,20			
Belgique				Canada			
1 198 490 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/25	1 288 577	0,06	1 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.750%, 01/02/25		
513 785 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.500%, 28/03/26	593 302	0,03	800 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.250%, 01/03/25	585 955	0,03
734 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.000%, 22/06/26	785 013	0,04	750 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/04/25	549 708	0,03
963 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/27	1 013 302	0,05	500 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.750%, 01/05/25	376 904	0,02
600 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.010%, 22/10/27	609 813	0,03	861 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.250%, 01/06/25	636 733	0,03
1 603 362 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 5.500%, 28/03/28	2 003 264	0,10	66 000 CAD	Canadian Government Bond, 9.000%, 01/06/25	53 378	0,00
1 434 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/28	1 489 959	0,07	1 800 000 CAD	Canadian Government Bond, 0.500%, 01/09/25	1 290 742	0,06
1 097 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.900%, 22/06/29	1 126 830	0,06	500 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.000%, 01/10/25	373 339	0,02
950 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.100%, 22/06/30	910 065	0,04	500 000 CAD	Canadian Government Bond, 4.500%, 01/11/25	383 263	0,02
932 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.000%, 22/06/31	930 071	0,05	1 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 4.500%, 01/02/26	769 854	0,04
800 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.010%, 22/10/31	730 969	0,04	1 700 000 CAD	Canadian Government Bond, 0.250%, 01/03/26	1 199 644	0,06
286 994 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.000%, 28/03/32	352 478	0,02	1 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.000%, 01/04/26	747 520	0,04
1 000 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.350%, 22/06/32	923 443	0,05	763 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/06/26	551 413	0,03
613 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.250%, 22/04/33	606 165	0,03	1 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.000%, 01/09/26	711 201	0,04
450 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.000%, 22/06/33	513 313	0,02	1 200 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.250%, 01/03/27	852 413	0,04
506 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.000%, 22/06/34	575 414	0,03	793 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.000%, 01/06/27	558 179	0,03
948 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 5.000%, 28/03/35	1 274 819	0,06	128 000 CAD	Canadian Government Bond, 8.000%, 01/06/27	111 781	0,01
448 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.450%, 22/06/37	417 964	0,02	800 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.245%, 24/08/27	605 351	0,03
504 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.900%, 22/06/38	491 421	0,02	900 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/09/27	669 581	0,03
1 050 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 2.750%, 22/04/39	1 133 008	0,06	750 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.500%, 01/03/28	574 922	0,03
825 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.400%, 22/06/40	607 880	0,03	566 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.000%, 01/06/28	409 597	0,02
755 471 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.250%, 28/03/41	975 792	0,05				
700 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.450%, 22/06/43	816 062	0,04				
510 167 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.750%, 22/06/45	623 473	0,03				
642 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.600%, 22/06/47	533 988	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)				
Canada (suite)				Chili				
500 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.250%, 01/09/28	380 631	0,02	350 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.500%, 01/03/26	394 315 0,02		
500 000 CAD	Canadian Government Bond, 4.000%, 01/03/29	394 809	0,02	200 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.000%, 01/10/28	226 036	0,01	
769 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.250%, 01/06/29	560 030	0,03	290 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.000%, 01/03/35	325 125	0,02	
256 000 CAD	Canadian Government Bond, 5.750%, 01/06/29	219 728	0,01	310 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 6.000%, 01/01/43	385 076	0,02	
700 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.250%, 01/12/29	508 538	0,02	Chili – Total			1 330 552	0,07
2 600 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.250%, 01/06/30	1 763 232	0,09	Chine				
2 250 000 CAD	Canadian Government Bond, 0.500%, 01/12/30	1 434 772	0,07	20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.770%, 08/03/25	2 883 055	0,14	
2 450 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/06/31	1 662 120	0,08	20 000 000 CNY	China Government Bond, 1.990%, 09/04/25	2 812 132	0,14	
1 550 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/12/31	1 044 399	0,05	25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.240%, 25/05/25	3 526 550	0,18	
1 350 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.000%, 01/06/32	941 202	0,05	10 800 000 CNY	China Government Bond, 3.610%, 07/06/25	1 558 951	0,08	
1 950 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.500%, 01/12/32	1 411 273	0,07	15 000 000 CNY	China Government Bond, 2.180%, 25/08/25	2 113 752	0,11	
2 400 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/06/33	1 770 805	0,09	5 800 000 CNY	China Government Bond, 3.600%, 06/09/25	838 735	0,04	
1 150 000 CAD	Canadian Government Bond, 5.750%, 01/06/33	1 057 309	0,05	20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.220%, 25/09/25	2 821 212	0,14	
1 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.250%, 01/12/33	769 058	0,04	20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.020%, 22/10/25	2 862 638	0,14	
498 000 CAD	Canadian Government Bond, 5.000%, 01/06/37	455 519	0,02	25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.280%, 25/11/25	3 527 150	0,18	
1 178 000 CAD	Canadian Government Bond, 4.000%, 01/06/41	1 002 765	0,05	21 600 000 CNY	China Government Bond, 3.220%, 06/12/25	3 108 156	0,15	
1 425 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.500%, 01/12/45	1 156 578	0,06	35 000 000 CNY	China Government Bond, 2.460%, 15/02/26	4 954 887	0,25	
662 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/12/48	478 045	0,02	20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.030%, 11/03/26	2 870 111	0,14	
2 369 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.000%, 01/12/51	1 451 385	0,07	22 000 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 06/06/26	3 182 403	0,16	
1 800 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.750%, 01/12/53	1 029 628	0,05	28 000 000 CNY	China Government Bond, 2.690%, 12/08/26	3 987 163	0,20	
500 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/12/55	358 755	0,02	15 000 000 CNY	China Government Bond, 2.180%, 15/08/26	2 109 099	0,11	
393 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/12/64	283 955	0,01	20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.120%, 05/12/26	2 890 358	0,14	
Canada – Total			32 898 903	1,64	10 000 000 CNY	China Government Bond, 2.370%, 20/01/27	1 410 973	0,07
				16 000 000 CNY	China Government Bond, 2.480%, 15/04/27	2 263 580	0,11	
				20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.850%, 04/06/27	2 865 204	0,14	
				10 000 000 CNY	China Government Bond, 2.500%, 25/07/27	1 416 500	0,07	
				25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.440%, 15/10/27	3 532 049	0,18	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
45 000 000 CNY	China Government Bond, 3.820%, 02/11/27	6 737 944	0,34	7 000 000 CNY	China Government Bond, 3.270%, 22/08/46	1 049 408	0,05
25 000 000 CNY	China Government Bond, 3.280%, 03/12/27	3 657 116	0,18	9 070 000 CNY	China Government Bond, 4.050%, 24/07/47	1 529 861	0,08
20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.640%, 15/01/28	2 846 733	0,14	6 000 000 CNY	China Government Bond, 4.280%, 23/10/47	1 049 581	0,05
15 000 000 CNY	China Government Bond, 3.010%, 13/05/28	2 171 512	0,11	5 800 000 CNY	China Government Bond, 4.220%, 19/03/48	1 007 987	0,05
20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.690%, 17/05/28	3 000 197	0,15	12 800 000 CNY	China Government Bond, 3.970%, 23/07/48	2 142 008	0,11
20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.400%, 15/07/28	2 820 789	0,14	15 150 000 CNY	China Government Bond, 4.080%, 22/10/48	2 584 079	0,13
15 800 000 CNY	China Government Bond, 3.540%, 16/08/28	2 350 774	0,12	21 300 000 CNY	China Government Bond, 3.860%, 22/07/49	3 521 939	0,18
30 000 000 CNY	China Government Bond, 2.910%, 14/10/28	4 327 205	0,22	20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.390%, 16/03/50	3 068 582	0,15
20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 22/11/28	2 934 125	0,15	10 000 000 CNY	China Government Bond, 3.810%, 14/09/50	1 646 259	0,08
18 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 24/03/29	2 579 851	0,13	17 000 000 CNY	China Government Bond, 3.720%, 12/04/51	2 763 021	0,14
17 000 000 CNY	China Government Bond, 2.750%, 15/06/29	2 430 342	0,12	11 000 000 CNY	China Government Bond, 3.530%, 18/10/51	1 734 886	0,09
10 000 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 25/09/29	1 418 869	0,07	26 000 000 CNY	China Government Bond, 3.320%, 15/04/52	3 959 646	0,20
10 000 000 CNY	China Government Bond, 3.130%, 21/11/29	1 460 887	0,07	37 000 000 CNY	China Government Bond, 3.120%, 25/10/52	5 441 852	0,27
10 000 000 CNY	China Government Bond, 2.790%, 15/12/29	1 430 233	0,07	19 000 000 CNY	China Government Bond, 3.400%, 15/07/72	3 002 971	0,15
20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 25/03/30	2 861 002	0,14	10 000 000 CNY	China Government Bond, 3.270%, 25/03/73	1 539 297	0,08
20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.680%, 21/05/30	2 842 306	0,14	Chine – Total		171 900 636	8,58
10 000 000 CNY	China Government Bond, 3.270%, 19/11/30	1 479 569	0,07	Colombie			
25 000 000 CNY	China Government Bond, 3.020%, 27/05/31	3 637 130	0,18	4 000 000 COP	Colombian TES, 6.250%, 26/11/25	979 143	0,05
15 000 000 CNY	China Government Bond, 2.890%, 18/11/31	2 162 925	0,11	4 000 000 COP	Colombian TES, 6.000%, 28/04/28	910 955	0,05
10 000 000 CNY	China Government Bond, 2.750%, 17/02/32	1 425 919	0,07	3 950 000 COP	Colombian TES, 7.000%, 26/03/31	879 329	0,04
10 000 000 CNY	China Government Bond, 2.760%, 15/05/32	1 427 202	0,07	2 000 000 COP	Colombian TES, 7.250%, 18/10/34	425 116	0,02
12 000 000 CNY	China Government Bond, 2.690%, 15/08/32	1 703 590	0,08	1 500 000 COP	Colombian TES, 9.250%, 28/05/42	351 268	0,02
12 000 000 CNY	China Government Bond, 2.600%, 01/09/32	1 692 135	0,08	500 000 COP	Colombian TES, 7.250%, 26/10/50	93 778	0,00
32 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 15/11/32	4 585 860	0,23	Colombie – Total		3 639 589	0,18
35 000 000 CNY	China Government Bond, 2.880%, 25/02/33	5 054 623	0,25	Croatie			
25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.670%, 25/05/33	3 547 700	0,18	200 000 EUR	Croatia Government International Bond, 2.700%, 15/06/28	220 634	0,01
10 000 000 CNY	China Government Bond, 4.630%, 11/08/34	1 680 635	0,08	700 000 EUR	Croatia Government International Bond, 1.125%, 04/03/33	652 364	0,03
19 800 000 CNY	China Government Bond, 3.740%, 22/09/35	3 117 547	0,16	Croatie – Total		872 998	0,04
5 800 000 CNY	China Government Bond, 3.910%, 23/10/38	939 881	0,05				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Chypre				Danemark (suite)			
203 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 2.375%, 25/09/28	220 910	0,01	3 000 000 DKK	Denmark Government Bond, 2.250%, 15/11/33	444 362	0,02
200 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 2.750%, 26/02/34	211 589	0,01	5 105 669 DKK	Denmark Government Bond, 4.500%, 15/11/39	966 191	0,05
100 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 2.750%, 03/05/49	93 163	0,01	3 750 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.250%, 15/11/52	316 583	0,02
Chypre – Total				Danemark – Total			
525 662				3 778 530			
République tchèque				Finlande			
6 380 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.400%, 17/09/25	275 558	0,01	196 000 EUR	Finland Government Bond, 4.000%, 04/07/25	220 755	0,01
7 520 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.000%, 26/06/26	311 498	0,02	482 000 EUR	Finland Government Bond, 0.875%, 15/09/25	517 980	0,03
9 360 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.250%, 10/02/27	373 519	0,02	576 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/04/26	609 835	0,03
7 220 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.500%, 25/08/28	306 108	0,02	200 000 EUR	Finland Government Bond, 1.375%, 15/04/27	214 311	0,01
9 800 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.750%, 23/07/29	416 005	0,02	464 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/27	481 374	0,02
10 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.050%, 29/11/29	361 282	0,02	262 000 EUR	Finland Government Bond, 2.750%, 04/07/28	295 525	0,02
6 640 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.950%, 15/05/30	250 797	0,01	332 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/28	337 767	0,02
5 500 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.000%, 30/09/30	264 369	0,01	500 000 EUR	Finland Government Bond, 2.875%, 15/04/29	567 790	0,03
10 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.200%, 13/03/31	376 718	0,02	277 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/29	276 965	0,01
12 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.750%, 23/06/32	461 571	0,02	300 000 EUR	Finland Government Bond, 0.010%, 15/09/30	283 263	0,01
15 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.500%, 11/11/32	707 905	0,04	232 000 EUR	Finland Government Bond, 0.750%, 15/04/31	228 480	0,01
7 880 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.000%, 13/10/33	302 400	0,02	350 000 EUR	Finland Government Bond, 0.125%, 15/09/31	324 098	0,02
10 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.900%, 14/04/34	488 523	0,02	450 000 EUR	Finland Government Bond, 1.500%, 15/09/32	458 498	0,02
5 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 3.500%, 30/05/35	217 075	0,01	300 000 EUR	Finland Government Bond, 3.000%, 15/09/33	343 733	0,02
2 780 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.200%, 04/12/36	129 134	0,01	300 000 EUR	Finland Government Bond, 1.125%, 15/04/34	288 068	0,01
1 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.950%, 30/07/37	35 877	0,00	450 000 EUR	Finland Government Bond, 0.125%, 15/04/36	363 986	0,02
2 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.500%, 24/04/40	63 861	0,00	250 000 EUR	Finland Government Bond, 2.750%, 15/04/38	275 572	0,01
880 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.850%, 26/11/57	44 284	0,00	200 000 EUR	Finland Government Bond, 0.250%, 15/09/40	146 782	0,01
République tchèque – Total				Finlande – Total			
5 386 484				7 288 449			
Danemark							
2 030 000 DKK	Denmark Government Bond, 1.750%, 15/11/25	297 024	0,01	300 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/04/43	217 581	0,01
3 510 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.500%, 15/11/27	489 944	0,02	281 000 EUR	Finland Government Bond, 1.375%, 15/04/47	236 173	0,01
4 240 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.500%, 15/11/29	574 155	0,03	275 000 EUR	Finland Government Bond, 0.125%, 15/04/52	150 313	0,01
4 500 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.010%, 15/11/31	564 678	0,03	Finlande – Total			
1 000 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.010%, 15/11/31	125 593	0,01	7 288 449			
				0,36			

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)				
France				France (suite)				
1 750 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/25	1 870 465	0,09	1 888 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/36	1 764 713	0,09	
3 267 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/03/25	3 485 757	0,17	1 550 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/38	1 393 669	0,07	
2 710 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/25	2 904 842	0,15	2 300 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/10/38	2 906 530	0,15	
2 009 331	EUR French Republic Government Bond OAT, 6.000%, 25/10/25	2 355 292	0,12	1 904 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.750%, 25/06/39	1 829 263	0,09	
2 232 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/11/25	2 400 389	0,12	1 700 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/40	1 300 806	0,07	
3 100 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/26	3 257 235	0,16	1 632 294	EUR French Republic Government Bond OAT, 4.500%, 25/04/41	2 199 096	0,11	
2 438 238	EUR French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/04/26	2 762 136	0,14	1 100 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 25/05/43	1 131 029	0,06	
3 246 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/26	3 433 840	0,17	850 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/06/44	588 517	0,03	
2 250 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 24/09/26	2 495 877	0,12	1 327 167	EUR French Republic Government Bond OAT, 3.250%, 25/05/45	1 530 224	0,08	
2 301 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.250%, 25/11/26	2 400 781	0,12	2 065 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 2.000%, 25/05/48	1 887 476	0,09	
2 700 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/27	2 781 382	0,14	1 989 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.500%, 25/05/50	1 596 778	0,08	
2 395 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/05/27	2 539 574	0,13	2 025 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/52	1 283 118	0,06	
3 003 291	EUR French Republic Government Bond OAT, 2.750%, 25/10/27	3 379 359	0,17	2 400 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/53	1 489 369	0,07	
2 650 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/02/28	2 758 563	0,14	1 300 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 3.000%, 25/05/54	1 411 216	0,07	
2 332 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/28	2 419 446	0,12	986 124	EUR French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/04/55	1 287 328	0,06	
3 324 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/11/28	3 424 190	0,17	1 119 510	EUR French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/04/60	1 481 354	0,07	
2 747 687	EUR French Republic Government Bond OAT, 5.500%, 25/04/29	3 518 442	0,18	897 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.750%, 25/05/66	709 622	0,04	
3 275 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/29	3 302 878	0,16	775 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/72	359 221	0,02	
2 500 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/29	2 423 161	0,12	2 500 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 2.750%, perpetual	2 828 153	0,14	
2 772 485	EUR French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 25/05/30	3 101 613	0,15	1 800 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 3.000%, perpetual	2 068 521	0,10	
3 850 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/30	3 636 870	0,18	France – Total			113 684 053	5,67
3 790 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.500%, 25/05/31	3 952 550	0,20	Allemagne				
3 050 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/31	2 798 376	0,14	1 150 000	EUR Bundesobligation, 0.010%, 11/04/25	1 227 334	0,06	
3 300 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/05/32	2 981 783	0,15	1 900 000	EUR Bundesobligation, 0.010%, 10/10/25	2 012 573	0,10	
1 828 164	EUR French Republic Government Bond OAT, 5.750%, 25/10/32	2 538 125	0,13	970 000	EUR Bundesobligation, 0.010%, 10/10/25	1 030 697	0,05	
2 700 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 2.000%, 25/11/32	2 872 529	0,14	1 500 000	EUR Bundesobligation, 0.010%, 10/04/26	1 577 059	0,08	
1 500 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/11/33	1 792 002	0,09	1 300 000	EUR Bundesobligation, 0.010%, 09/10/26	1 355 354	0,07	
2 419 000	EUR French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/34	2 348 605	0,12	1 250 000	EUR Bundesobligation, 0.010%, 16/04/27	1 293 380	0,06	
2 031 825	EUR French Republic Government Bond OAT, 4.750%, 25/04/35	2 701 988	0,13	2 400 000	EUR Bundesobligation, 1.300%, 15/10/27	2 588 620	0,13	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
1 400 000 EUR	Bundesobligation, 1.300%, 15/10/27	1 513 771	0,08	1 500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.700%, 15/08/32	1 622 328	0,08
2 350 000 EUR	Bundesobligation, 2.200%, 13/04/28	2 620 823	0,13	1 750 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.300%, 15/02/33	1 982 220	0,10
800 000 EUR	Bundesobligation, 2.400%, 19/10/28	902 057	0,05	1 300 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.600%, 15/08/33	1 507 718	0,08
1 610 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/25	1 732 513	0,09	1 234 337 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/34	1 706 093	0,09
1 720 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.000%, 15/08/25	1 854 265	0,09	950 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/05/35	826 962	0,04
2 430 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/26	2 586 672	0,13	1 550 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/05/36	1 313 469	0,07
2 069 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/26	2 163 657	0,11	1 672 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.000%, 04/01/37	2 223 278	0,11
1 724 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/27	1 803 578	0,09	950 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.000%, 15/05/38	892 561	0,04
612 539 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.500%, 04/07/27	777 535	0,04	1 172 647 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.250%, 04/07/39	1 631 110	0,08
1 601 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/08/27	1 679 039	0,08	1 458 603 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/40	2 157 684	0,10
1 250 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/27	1 280 731	0,06	1 161 121 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 3.250%, 04/07/42	1 466 472	0,07
890 285 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.625%, 04/01/28	1 120 773	0,06	1 627 330 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.500%, 04/07/44	1 859 235	0,09
1 577 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/28	1 645 472	0,08	2 097 627 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.500%, 15/08/46	2 408 022	0,12
622 514 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/28	770 131	0,04	1 925 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.250%, 15/08/48	1 728 252	0,09
1 422 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/08/28	1 458 201	0,07	1 570 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/50	967 428	0,05
1 650 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/28	1 663 572	0,08	700 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/50	433 332	0,02
1 980 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/29	2 015 949	0,10	1 400 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/52	825 202	0,04
1 227 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/29	1 221 451	0,06	1 550 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.800%, 15/08/53	1 545 627	0,08
1 100 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.100%, 15/11/29	1 227 400	0,06	1 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.800%, 15/08/53	999 918	0,05
1 266 999 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.250%, 04/01/30	1 739 341	0,09	800 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.300%, perpetual	906 715	0,05
1 600 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/30	1 575 920	0,08	1 000 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.200%, 12/12/24	1 095 890	0,05
1 800 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/30	1 757 878	0,09	1 200 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.500%, 13/03/25	1 320 503	0,07
950 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/30	928 682	0,05	700 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 3.100%, 18/09/25	780 709	0,04
2 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.400%, 15/11/30	2 274 917	0,11	500 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.800%, perpetual	553 380	0,03
930 610 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.500%, 04/01/31	1 266 977	0,06	Allemagne – Total		89 724 155	4,48
1 550 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/31	1 497 617	0,07	Hong Kong			
1 700 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/31	1 625 984	0,08	300 000 HKD	Hong Kong Government Bond Programme, 1.250%, 29/06/27	35 949	0,00
1 200 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/31	1 148 218	0,06	Hong-Kong – Total		35 949	0,00
2 150 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/32	2 031 906	0,10				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Hongrie				Indonésie (suite)			
118 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.750%, 22/12/26	311 636	0,02	5 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.125%, 15/06/43	336 897	0,02
78 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 27/10/27	206 570	0,01	3 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.375%, 15/05/48	205 413	0,01
75 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 4.500%, 23/03/28	206 481	0,01	Indonésie – Total			
17 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 6.750%, 22/10/28	52 526	0,00	15 632 943 0,78			
135 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 21/08/30	334 092	0,02	Irlande			
23 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.250%, 22/10/31	56 509	0,00	217 443 EUR	Ireland Government Bond, 5.400%, 13/03/25	246 984	0,01
240 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.250%, 20/04/33	524 246	0,03	1 081 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.000%, 15/05/26	1 159 700	0,06
250 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.250%, 22/06/34	525 439	0,03	450 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.200%, 15/05/27	465 820	0,02
50 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 27/10/38	101 126	0,00	451 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.900%, 15/05/28	473 202	0,02
Hongrie – Total				756 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.100%, 15/05/29	790 437	0,04
2 318 625 0,12				434 628 EUR	Ireland Government Bond, 2.400%, 15/05/30	485 201	0,03
Indonésie				650 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.200%, 18/10/30	625 879	0,03
14 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.500%, 15/06/25	909 559	0,05	324 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.350%, 18/03/31	336 658	0,02
12 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 5.500%, 15/04/26	765 274	0,04	850 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.010%, 18/10/31	787 903	0,04
10 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 5.125%, 15/04/27	626 661	0,03	300 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.350%, 18/10/32	279 376	0,01
8 200 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/05/27	541 625	0,03	244 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.300%, 15/05/33	245 158	0,01
16 400 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.125%, 15/05/28	1 052 063	0,05	200 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.400%, 15/05/35	175 454	0,01
13 200 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.375%, 15/08/28	855 167	0,04	311 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.700%, 15/05/37	306 529	0,02
8 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 9.000%, 15/03/29	575 780	0,03	275 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.550%, 22/04/41	212 876	0,01
4 550 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.250%, 15/05/29	318 491	0,02	400 000 EUR	Ireland Government Bond, 3.000%, 18/10/43	458 571	0,02
12 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/09/30	797 672	0,04	485 074 EUR	Ireland Government Bond, 2.000%, 18/02/45	463 703	0,02
12 300 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/08/32	845 830	0,04	453 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.500%, 15/05/50	377 497	0,02
36 500 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/02/33	2 454 748	0,12	Irlande – Total			
8 700 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.625%, 15/05/33	567 537	0,03	7 890 948 0,39			
16 600 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 15/03/34	1 217 998	0,06	Israël			
11 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/06/35	763 692	0,04	600 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 0.500%, 30/04/25	159 452	0,01
8 700 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.250%, 15/05/36	637 602	0,03	545 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.750%, 31/08/25	146 378	0,01
4 400 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/05/38	305 874	0,01	1 168 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 6.250%, 30/10/26	346 777	0,02
5 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 15/04/39	373 543	0,02	500 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 2.000%, 31/03/27	131 932	0,01
22 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.125%, 15/06/42	1 481 517	0,07	1 400 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 2.250%, 28/09/28	365 208	0,02
				1 050 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.000%, 31/03/30	246 869	0,01
				1 000 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.300%, 30/04/32	226 012	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Israël (suite)				Italie (suite)			
1 350 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.500%, 31/05/37	268 980	0,01	1 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.850%, 15/01/27	1 356 172	0,07
839 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 5.500%, 31/01/42	264 459	0,01	1 650 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.100%, 01/04/27	1 727 876	0,09
1 700 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 3.750%, 31/03/47	418 001	0,02	780 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.200%, 01/06/27	845 075	0,04
1 000 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 2.800%, 29/11/52	197 249	0,01	753 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.050%, 01/08/27	810 291	0,04
Israël – Total		2 771 317	0,14	1 750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 15/09/27	1 806 846	0,09
Italie				1 464 991 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.500%, 01/11/27	1 830 624	0,09
1 247 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 01/12/24	1 367 553	0,07	1 050 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.650%, 01/12/27	1 150 940	0,06
1 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 15/12/24	1 071 378	0,05	1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.000%, 01/02/28	1 602 080	0,08
1 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.350%, 01/02/25	1 071 301	0,05	900 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.250%, 15/03/28	891 287	0,04
1 369 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/03/25	1 543 147	0,08	1 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.400%, 01/04/28	1 125 362	0,06
950 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.400%, 28/03/25	1 052 272	0,05	1 050 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.500%, 15/07/28	1 041 412	0,05
1 392 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.450%, 15/05/25	1 505 351	0,07	1 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.800%, 01/08/28	1 599 818	0,08
987 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.500%, 01/06/25	1 067 263	0,05	1 147 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.750%, 01/09/28	1 364 671	0,07
500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.850%, 01/07/25	542 941	0,03	1 366 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 01/12/28	1 497 816	0,07
750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.200%, 15/08/25	805 555	0,04	1 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.100%, 01/02/29	1 158 546	0,06
800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.600%, 29/09/25	892 990	0,04	1 550 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.450%, 15/02/29	1 504 945	0,07
1 182 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 15/11/25	1 297 510	0,06	1 100 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 15/06/29	1 197 569	0,06
1 066 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.000%, 01/12/25	1 159 058	0,06	1 182 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.000%, 01/08/29	1 300 774	0,06
1 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.500%, 15/01/26	1 118 933	0,06	1 324 406 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.250%, 01/11/29	1 629 773	0,08
2 250 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.500%, 01/02/26	2 368 596	0,12	1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 15/12/29	1 717 140	0,09
681 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.500%, 01/03/26	778 393	0,04	1 480 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.500%, 01/03/30	1 665 651	0,08
1 350 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/04/26	1 400 459	0,07	1 350 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.350%, 01/04/30	1 336 960	0,07
1 100 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.800%, 15/04/26	1 241 617	0,06	1 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/08/30	1 098 406	0,05
1 205 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.600%, 01/06/26	1 294 924	0,06	1 200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 15/11/30	1 382 289	0,07
1 210 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.100%, 15/07/26	1 314 759	0,07	1 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.650%, 01/12/30	1 290 918	0,06
1 050 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/08/26	1 080 466	0,05	1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.900%, 01/04/31	1 401 337	0,07
800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 15/09/26	907 439	0,05	1 364 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.000%, 01/05/31	1 772 080	0,09
363 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 7.250%, 01/11/26	449 331	0,02	1 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.600%, 01/08/31	1 173 551	0,06
1 351 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.250%, 01/12/26	1 429 837	0,07	1 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 30/10/31	1 611 649	0,08

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)				
Italie (suite)				Italie (suite)				
1 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/12/31	1 286 233	0,06	1 200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.450%, 01/09/50	969 410	0,05	
1 318 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.650%, 01/03/32	1 273 254	0,06	750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.700%, 01/09/51	508 575	0,03	
1 140 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/06/32	1 031 342	0,05	550 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.150%, 01/09/52	404 348	0,02	
1 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 01/12/32	1 019 990	0,05	600 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.500%, 01/10/53	681 746	0,03	
1 199 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.750%, 01/02/33	1 546 829	0,08	641 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 01/03/67	518 584	0,03	
1 450 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.400%, 01/05/33	1 706 993	0,09	450 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.150%, 01/03/72	303 400	0,02	
1 021 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.450%, 01/09/33	1 023 860	0,05	500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.700%, perpetual	566 669	0,03	
1 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.350%, 01/11/33	1 637 863	0,08	Italie – Total			102 621 452	5,12
1 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.200%, 01/03/34	1 153 774	0,06	Japon				
1 233 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/08/34	1 516 488	0,08	300 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/12/24	2 131 026	0,11	
889 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.350%, 01/03/35	944 461	0,05	350 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/03/25	2 486 445	0,12	
650 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 30/04/35	733 360	0,04	425 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/06/25	3 019 948	0,15	
1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.450%, 01/03/36	1 275 291	0,06	375 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/09/25	2 664 287	0,13	
1 023 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.250%, 01/09/36	947 338	0,05	400 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/12/25	2 842 077	0,14	
1 377 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 01/02/37	1 539 889	0,08	575 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/03/26	4 076 594	0,20	
1 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/03/37	890 260	0,04	625 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/06/26	4 430 460	0,22	
650 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.250%, 01/03/38	659 410	0,03	625 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/09/26	4 428 731	0,22	
945 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.950%, 01/09/38	925 402	0,05	600 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/12/26	4 248 815	0,21	
827 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/08/39	1 009 002	0,05	700 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/03/27	4 955 015	0,25	
756 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.100%, 01/03/40	739 695	0,04	520 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/03/27	3 692 229	0,18	
954 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/09/40	1 164 352	0,06	900 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/06/27	6 364 733	0,32	
1 550 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.800%, 01/03/41	1 234 861	0,06	675 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/09/27	4 787 626	0,24	
1 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.450%, 01/09/43	1 310 287	0,07	370 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.200%, 20/12/27	2 631 178	0,13	
978 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.750%, 01/09/44	1 162 022	0,06	400 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.300%, 20/12/27	2 855 951	0,14	
900 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.500%, 30/04/45	628 842	0,03	140 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/03/28	990 477	0,05	
893 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.250%, 01/09/46	854 811	0,04	250 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.200%, 20/03/28	1 776 138	0,09	
877 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.700%, 01/03/47	763 630	0,04	200 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/06/28	1 413 747	0,07	
1 322 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.450%, 01/03/48	1 304 674	0,06	300 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.200%, 20/06/28	2 129 749	0,11	
701 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 01/09/49	731 576	0,04	250 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.300%, 20/06/28	1 782 451	0,09	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
180 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.400%, 20/09/28	1 287 732	0,06	612 300 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/28	4 335 873	0,22
11 600 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.400%, 20/03/48	96 452	0,01	230 700 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/28	1 631 477	0,08
75 400 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.200%, 20/03/49	603 168	0,03	516 700 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/28	3 645 964	0,18
87 700 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.200%, 20/03/50	701 606	0,04	381 500 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/28	2 689 875	0,13
78 900 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.200%, 20/03/51	630 349	0,03	290 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/29	2 042 815	0,10
95 300 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.000%, 20/03/52	731 122	0,04	393 100 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/29	2 767 817	0,14
116 200 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.900%, 20/03/53	872 085	0,04	425 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/29	2 989 530	0,15
128 900 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.700%, 20/03/54	922 680	0,05	385 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/29	2 705 514	0,14
104 100 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.400%, 20/03/55	689 860	0,03	325 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/30	2 283 599	0,11
211 900 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.400%, 20/03/56	1 027 786	0,05	696 200 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/30	4 882 980	0,24
191 600 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.900%, 20/03/57	1 088 198	0,05	480 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/30	3 353 293	0,17
123 400 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.800%, 20/03/58	673 186	0,03	510 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/30	3 553 395	0,18
233 500 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.500%, 20/03/59	1 133 282	0,06	325 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/31	2 257 987	0,11
266 100 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.500%, 20/03/60	1 278 443	0,06	425 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/31	2 944 221	0,15
235 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.700%, 20/03/61	1 202 854	0,06	625 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/31	4 317 323	0,22
260 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.000%, 20/03/62	1 463 879	0,07	615 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/31	4 235 988	0,21
200 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.300%, 20/03/63	1 231 522	0,06	695 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.200%, 20/03/32	4 820 238	0,24
379 900 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/03/25	2 709 098	0,14	1 000 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.200%, 20/06/32	6 909 278	0,35
408 400 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/06/25	2 914 738	0,15	750 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.200%, 20/09/32	5 175 787	0,26
424 100 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/09/25	3 028 834	0,15	695 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.500%, 20/12/32	4 906 854	0,25
383 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.300%, 20/12/25	2 731 938	0,14	550 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.500%, 20/03/33	3 874 071	0,19
465 700 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/26	3 309 152	0,17	230 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/06/33	1 601 696	0,08
436 300 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/26	3 100 490	0,15	350 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.800%, 20/09/33	2 525 074	0,13
388 600 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/26	2 760 995	0,14	180 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/02/30	1 442 107	0,07
443 400 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/26	3 149 876	0,16	100 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/05/32	814 406	0,04
528 600 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/27	3 753 292	0,19	7 300 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.800%, 22/11/32	57 401	0,00
434 100 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/27	3 080 946	0,15	57 400 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/12/32	437 206	0,02
590 600 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/27	4 188 032	0,21	50 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.100%, 20/03/33	372 290	0,02
410 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/27	2 906 324	0,15	150 400 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/06/33	1 174 961	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
8 700 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.100%, 20/09/33	70 509	0,00	144 500 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/12/43	1 079 865	0,05
151 600 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.000%, 20/12/33	1 216 123	0,06	142 800 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/03/44	1 065 561	0,05
77 200 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/03/34	641 174	0,03	104 300 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/06/44	776 317	0,04
70 800 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/06/34	594 613	0,03	146 900 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/09/44	1 092 362	0,05
22 100 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/09/34	185 685	0,01	113 400 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.500%, 20/12/44	813 209	0,04
46 400 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/12/34	386 685	0,02	231 600 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.500%, 20/03/45	1 658 048	0,08
26 700 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/03/35	220 696	0,01	156 700 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.600%, 20/06/45	1 140 015	0,06
16 150 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/06/35	133 563	0,01	164 200 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/09/45	1 153 325	0,06
93 500 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/09/35	789 504	0,04	165 800 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/12/45	1 159 224	0,06
12 200 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/12/35	101 020	0,01	135 100 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/03/46	835 257	0,04
87 100 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/03/36	736 062	0,04	153 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.300%, 20/06/46	840 328	0,04
145 600 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/06/36	1 231 290	0,06	103 800 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.500%, 20/09/46	595 160	0,03
36 300 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/09/36	307 126	0,02	109 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.600%, 20/12/46	637 694	0,03
23 800 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/12/36	197 438	0,01	174 600 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/03/47	1 065 917	0,05
63 300 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/03/37	530 718	0,03	108 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/06/47	657 522	0,03
56 600 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/09/37	479 763	0,02	97 200 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/09/47	590 708	0,03
120 500 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/03/38	1 021 361	0,05	150 300 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/12/47	909 561	0,05
55 800 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/09/38	469 637	0,02	230 900 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/03/48	1 392 868	0,07
121 800 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/03/39	1 008 051	0,05	102 100 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/06/48	599 405	0,03
17 400 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.200%, 20/09/39	142 151	0,01	130 900 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.900%, 20/09/48	803 738	0,04
78 400 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/03/40	647 837	0,03	71 300 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/12/48	415 126	0,02
187 500 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.000%, 20/09/40	1 485 862	0,07	146 100 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.500%, 20/03/49	804 545	0,04
97 200 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.200%, 20/03/41	789 831	0,04	133 200 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.400%, 20/06/49	710 822	0,04
131 200 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.000%, 20/09/41	1 034 970	0,05	135 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.400%, 20/09/49	717 536	0,04
166 700 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.000%, 20/03/42	1 314 232	0,07	140 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.400%, 20/12/49	743 982	0,04
141 600 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.900%, 20/09/42	1 097 957	0,06	165 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.400%, 20/03/50	870 996	0,04
151 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.800%, 20/03/43	1 149 873	0,06	195 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.600%, 20/06/50	1 083 275	0,05
129 500 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.900%, 20/06/43	1 000 093	0,05	300 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.600%, 20/09/50	1 661 661	0,08
134 200 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.800%, 20/09/43	1 019 018	0,05	220 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/12/50	1 249 403	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
205 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/03/51	1 160 363	0,06	150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/09/26	1 128 937	0,06
200 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/06/51	1 128 231	0,06	206 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/26	1 551 159	0,08
215 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/09/51	1 209 707	0,06	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/03/27	1 506 795	0,08
205 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/12/51	1 151 522	0,06	136 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/27	1 034 746	0,05
235 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.000%, 20/03/52	1 428 419	0,07	12 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/06/27	92 386	0,00
185 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.300%, 20/06/52	1 210 688	0,06	196 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/27	1 495 763	0,07
180 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/09/52	1 205 482	0,06	129 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/09/27	985 864	0,05
175 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.600%, 20/12/52	1 226 638	0,06	48 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/27	373 034	0,02
130 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/03/53	868 772	0,04	29 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.400%, 20/03/28	225 012	0,01
100 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.200%, 20/06/53	634 934	0,03	100 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/28	769 868	0,04
50 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.800%, 20/09/53	366 329	0,02	250 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/06/28	1 940 346	0,10
47 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/12/24	346 560	0,02	10 150 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.400%, 20/06/28	79 098	0,00
11 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/24	84 011	0,00	12 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/28	94 181	0,00
150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/03/25	1 089 144	0,05	188 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/09/28	1 458 529	0,07
26 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/03/25	189 739	0,01	12 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/12/28	99 211	0,01
29 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/25	211 033	0,01	29 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/28	224 743	0,01
20 300 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/06/25	148 018	0,01	10 750 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/03/29	82 832	0,00
150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/06/25	1 095 506	0,05	11 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/29	90 225	0,00
34 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/25	254 468	0,01	8 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/29	67 944	0,00
14 500 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/09/25	106 398	0,01	9 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/06/29	77 692	0,00
58 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/25	426 856	0,02	298 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/29	2 339 132	0,12
25 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/12/25	190 932	0,01	29 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/29	228 063	0,01
58 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/25	429 028	0,02	85 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/12/29	675 343	0,03
19 300 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/26	143 148	0,01	225 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/30	1 782 226	0,09
58 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/26	432 070	0,02	29 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/30	230 192	0,01
258 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/03/26	1 922 825	0,10	52 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/06/30	401 168	0,02
150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/06/26	1 120 829	0,06	11 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/06/30	90 196	0,00
110 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/06/26	829 939	0,04	100 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/06/30	787 126	0,04
34 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/09/26	261 262	0,01	81 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/09/30	634 527	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
300 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/12/30	2 368 293	0,12	191 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.200%, 20/03/35	1 422 263	0,07
163 300 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/30	1 298 570	0,07	199 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.300%, 20/06/35	1 494 688	0,07
15 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/03/31	123 326	0,01	154 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.200%, 20/09/35	1 149 504	0,06
150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/03/31	1 186 583	0,06	137 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.000%, 20/12/35	996 103	0,05
114 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/31	914 847	0,05	164 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/03/36	1 112 266	0,06
50 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/06/31	390 687	0,02	219 300 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.200%, 20/06/36	1 432 574	0,07
129 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/06/31	1 021 398	0,05	160 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/09/36	1 089 740	0,05
43 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/09/31	333 999	0,02	146 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.600%, 20/12/36	997 155	0,05
199 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/09/31	1 558 095	0,08	134 500 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.700%, 20/03/37	926 598	0,05
8 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/12/31	62 982	0,00	167 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.600%, 20/06/37	1 135 141	0,06
191 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/12/31	1 496 485	0,07	115 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.600%, 20/09/37	778 938	0,04
36 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/03/32	282 795	0,01	189 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.600%, 20/12/37	1 278 653	0,06
108 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/03/32	841 314	0,04	132 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/03/38	873 431	0,04
164 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/03/32	1 295 103	0,06	157 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/06/38	1 039 286	0,05
18 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/06/32	142 804	0,01	184 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.700%, 20/09/38	1 241 772	0,06
227 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/06/32	1 758 858	0,09	308 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/12/38	2 010 083	0,10
128 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/06/32	999 059	0,05	204 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/03/39	1 305 250	0,07
287 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/09/32	2 241 231	0,11	295 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.300%, 20/06/39	1 849 661	0,09
138 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/12/32	1 081 450	0,05	400 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.300%, 20/09/39	2 495 361	0,12
96 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/12/32	758 105	0,04	305 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.300%, 20/12/39	1 893 778	0,09
148 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/03/33	1 145 099	0,06	260 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/03/40	1 632 571	0,08
190 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/03/33	1 478 263	0,07	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/06/40	1 249 709	0,06
271 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/06/33	2 118 495	0,11	295 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/09/40	1 833 926	0,09
273 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/09/33	2 139 808	0,11	265 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/12/40	1 668 252	0,08
288 500 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/12/33	2 235 374	0,11	305 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/03/41	1 909 874	0,10
254 500 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/03/34	1 957 762	0,10	290 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/06/41	1 776 615	0,09
506 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/06/34	3 898 226	0,19	195 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/09/41	1 211 551	0,06
304 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.400%, 20/09/34	2 311 177	0,12	360 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/12/41	2 226 775	0,11
231 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.200%, 20/12/34	1 727 637	0,09	425 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.800%, 20/03/42	2 765 756	0,14

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Japon (suite)				Corée (suite)			
315 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.900%, 20/06/42	2 079 362	0,10	1 380 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.875%, 10/06/29	1 001 901	0,05
450 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.100%, 20/09/42	3 067 265	0,15	1 500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.375%, 10/12/29	1 053 160	0,05
280 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.400%, 20/12/42	2 002 046	0,10	70 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 5.500%, 10/12/29	61 111	0,00
170 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.100%, 20/03/43	1 152 341	0,06	600 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.375%, 10/06/30	416 726	0,02
110 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.100%, 20/06/43	743 565	0,04	2 950 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/12/30	2 044 927	0,10
200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/09/43	1 445 042	0,07	323 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 4.750%, 10/12/30	274 760	0,01
250 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/01/25	1 774 206	0,09	2 700 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.000%, 10/06/31	1 929 169	0,10
160 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/02/25	1 135 571	0,06	445 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 4.000%, 10/12/31	364 546	0,02
100 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/03/25	709 618	0,04	1 800 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.375%, 10/06/32	1 413 820	0,07
250 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/04/25	1 774 596	0,09	1 500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.250%, 10/06/33	1 165 600	0,06
100 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/05/25	709 938	0,04	625 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.750%, 10/12/33	508 073	0,03
150 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/06/25	1 064 396	0,05	425 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.625%, 10/09/35	312 198	0,02
150 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/07/25	1 064 268	0,05	375 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/09/36	240 401	0,01
70 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/10/25	496 420	0,03	905 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.250%, 10/09/37	631 441	0,03
Japon – Total		391 453 810	19,53	95 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.375%, 10/09/38	66 983	0,00
Corée				600 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.125%, 10/09/39	347 874	0,02
1 200 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/03/25	911 791	0,05	1 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/09/40	616 344	0,03
520 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.250%, 10/06/25	397 721	0,02	1 650 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.875%, 10/09/41	1 059 625	0,05
2 600 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.125%, 10/09/25	1 947 731	0,10	1 100 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.250%, 10/09/42	867 068	0,04
400 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.250%, 10/12/25	304 824	0,02	480 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.000%, 10/12/42	364 612	0,02
2 800 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.250%, 10/03/26	2 084 972	0,10	430 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.750%, 10/12/44	315 971	0,02
405 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.875%, 10/06/26	304 613	0,01	420 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.000%, 10/03/46	268 396	0,01
2 255 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/12/26	1 667 803	0,08	2 125 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.125%, 10/03/47	1 385 704	0,07
325 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.125%, 10/06/27	243 587	0,01	1 655 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.625%, 10/03/48	1 181 322	0,06
1 085 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.375%, 10/12/27	817 404	0,04	1 865 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.000%, 10/03/49	1 172 889	0,06
1 500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.250%, 10/03/28	1 167 138	0,06	1 700 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/03/50	946 962	0,05
1 225 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.625%, 10/06/28	929 685	0,05	2 350 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.875%, 10/03/51	1 426 429	0,07
1 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.500%, 10/09/28	787 167	0,04	2 350 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.500%, 10/03/52	1 628 972	0,08
1 365 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.375%, 10/12/28	1 021 491	0,05				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets			
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)						
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)						
Corée (suite)				Malaisie (suite)						
3 400 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.125%, 10/09/52	2 673 945	0,13	370 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.733%, 15/06/28	80 989	0,01			
500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.625%, 10/09/53	429 186	0,02	55 000 MYR	Malaysia Government Bond, 5.248%, 15/09/28	12 814	0,00			
Corée – Total		38 756 042	1,93	4 550 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.504%, 30/04/29	1 030 597	0,05			
Lettonie				6 205 000 MYR				Malaysia Government Bond, 3.885%, 15/08/29	1 363 790	0,07
100 000 EUR	Latvia Government International Bond, 0.375%, 07/10/26	103 006	0,01	1 160 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.498%, 15/04/30	263 309	0,01			
100 000 EUR	Latvia Government International Bond, 1.125%, 30/05/28	102 390	0,00	85 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.127%, 15/04/32	18 905	0,00			
300 000 EUR	Latvia Government International Bond, 1.375%, 16/05/36	262 107	0,01	3 500 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.582%, 15/07/32	748 871	0,04			
Lettonie – Total		467 503	0,02	2 320 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.642%, 07/11/33	542 441	0,03			
Lituanie				230 000 MYR				Malaysia Government Bond, 4.254%, 31/05/35	51 496	0,00
76 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 2.125%, 29/10/26	82 033	0,01	695 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.762%, 07/04/37	163 182	0,01			
58 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 0.950%, 26/05/27	59 589	0,00	290 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.893%, 08/06/38	69 380	0,00			
58 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 2.125%, 22/10/35	56 455	0,00	2 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.757%, 22/05/40	416 871	0,02			
29 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 2.100%, 26/05/47	25 534	0,00	2 250 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.696%, 15/10/42	527 283	0,03			
100 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 1.625%, 19/06/49	73 666	0,01	520 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.736%, 15/03/46	121 309	0,01			
50 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 0.500%, 28/07/50	27 607	0,00	960 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.921%, 06/07/48	231 158	0,01			
Lituanie – Total		324 884	0,02	3 200 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.065%, 15/06/50	678 574	0,03			
Luxembourg				820 000 MYR				Malaysia Government Investment Issue, 4.128%, 15/08/25	180 607	0,01
116 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 0.625%, 01/02/27	121 322	0,01	1 160 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.258%, 26/07/27	258 267	0,01			
58 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 2.250%, 19/03/28	63 874	0,00	1 160 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.369%, 31/10/28	260 698	0,01			
200 000 EUR	State of the Grand-Duchy of Luxembourg, 0.010%, 14/09/32	179 568	0,01	950 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.130%, 09/07/29	211 138	0,01			
300 000 EUR	State of the Grand-Duchy of Luxembourg, 3.250%, 02/03/43	351 083	0,02	3 900 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.193%, 07/10/32	871 987	0,04			
Luxembourg – Total		715 847	0,04	815 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.724%, 15/06/33	189 786	0,01			
Malaisie				1 045 000 MYR				Malaysia Government Investment Issue, 4.582%, 30/08/33	242 097	0,01
205 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.392%, 15/04/26	45 549	0,00	465 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.786%, 31/10/35	109 360	0,01			
1 500 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.906%, 15/07/26	329 879	0,02	1 870 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.755%, 04/08/37	439 798	0,02			
3 030 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.900%, 30/11/26	667 226	0,03	1 750 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.467%, 15/09/39	398 139	0,02			
2 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.502%, 31/05/27	434 890	0,02	2 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.291%, 14/08/43	557 394	0,03			
3 350 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.899%, 16/11/27	737 984	0,04	435 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.895%, 08/05/47	103 343	0,01			
1 200 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.519%, 20/04/28	260 553	0,01	Malaisie – Total		12 619 664	0,63			

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Mexique				Pays-Bas (suite)			
8 150 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 05/12/24	478 932	0,02	1 184 702 EUR	Netherlands Government Bond, 2.750%, 15/01/47	1 372 375	0,07
28 975 000 MXN	Mexican Bonos, 5.750%, 05/03/26	1 577 512	0,08	1 000 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/52	569 558	0,03
9 000 000 MXN	Mexican Bonos, 5.500%, 04/03/27	475 986	0,02	400 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.000%, 15/01/54	399 057	0,02
18 425 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 03/06/27	1 032 320	0,05	800 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, perpetual	900 564	0,04
18 099 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 31/05/29	1 049 655	0,05				
16 200 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 29/05/31	895 728	0,05				
20 000 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 26/05/33	1 074 422	0,05				
8 825 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 23/11/34	478 732	0,02	Pays-Bas – Total			
10 000 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 24/05/35	542 904	0,03			20 864 950	1,04
3 350 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 20/11/36	214 299	0,01	Nouvelle-Zélande			
13 575 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 18/11/38	768 840	0,04	355 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.750%, 15/04/25	218 542	0,01
11 450 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 13/11/42	597 831	0,03	500 000 NZD	New Zealand Government Bond, 0.500%, 15/05/26	289 087	0,02
17 300 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 07/11/47	918 710	0,05	990 000 NZD	New Zealand Government Bond, 4.500%, 15/04/27	631 074	0,03
15 000 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 31/07/53	792 149	0,04	500 000 NZD	New Zealand Government Bond, 0.250%, 15/05/28	267 306	0,01
Mexique – Total							
		10 898 020	0,54	771 000 NZD	New Zealand Government Bond, 3.000%, 20/04/29	461 617	0,02
Pays-Bas							
1 392 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/25	1 485 054	0,07	350 000 NZD	New Zealand Government Bond, 1.500%, 15/05/31	183 146	0,01
800 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/26	842 132	0,04	750 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.000%, 15/05/32	398 752	0,02
831 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/26	879 447	0,04	432 000 NZD	New Zealand Government Bond, 3.500%, 14/04/33	256 237	0,01
1 400 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/27	1 448 879	0,07	250 000 NZD	New Zealand Government Bond, 4.250%, 15/05/34	156 589	0,01
929 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/27	978 665	0,05	425 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.750%, 15/04/37	221 196	0,01
549 956 EUR	Netherlands Government Bond, 5.500%, 15/01/28	685 106	0,03	250 000 NZD	New Zealand Government Bond, 1.750%, 15/05/41	104 190	0,01
436 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/28	453 375	0,02	1 050 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.750%, 15/05/51	474 094	0,02
1 000 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/29	993 567	0,05	Nouvelle-Zélande – Total			
714 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/29	712 475	0,04			3 661 830	0,18
750 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/30	720 966	0,04	Norvège			
1 000 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/31	937 981	0,05	4 390 000 NOK	Norway Government Bond, 1.750%, 17/02/27	411 935	0,02
850 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/32	810 673	0,04	2 320 000 NOK	Norway Government Bond, 2.000%, 26/04/28	217 019	0,01
1 014 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/01/33	1 140 165	0,06	2 380 000 NOK	Norway Government Bond, 1.750%, 06/09/29	216 029	0,01
500 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/07/33	560 499	0,03	3 000 000 NOK	Norway Government Bond, 1.375%, 19/08/30	262 301	0,01
1 005 839 EUR	Netherlands Government Bond, 4.000%, 15/01/37	1 296 843	0,06	4 000 000 NOK	Norway Government Bond, 1.250%, 17/09/31	340 790	0,02
650 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/38	508 295	0,03	2 000 000 NOK	Norway Government Bond, 2.125%, 18/05/32	180 435	0,01
848 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/01/40	694 473	0,03	2 000 000 NOK	Norway Government Bond, 3.000%, 15/08/33	192 670	0,01
1 049 393 EUR	Netherlands Government Bond, 3.750%, 15/01/42	1 367 696	0,07	1 500 000 NOK	Norway Government Bond, 3.500%, 06/10/42	155 533	0,01
900 000 EUR	Netherlands Government Bond, 3.250%, 15/01/44	1 107 105	0,06	Norvège – Total			
						1 976 712	0,10

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Pérou				Portugal (suite)			
3 000 000 PEN	Peru Government Bond, 5.940%, 12/02/29	809 974	0,04	401 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.100%, 15/04/37	494 233	0,02
1 500 000 PEN	Peru Government Bond, 6.150%, 12/08/32	396 107	0,02	250 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 3.500%, 18/06/38	288 316	0,01
1 000 000 PEN	Peru Government Bond, 5.350%, 12/08/40	231 756	0,01	200 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.150%, 11/04/42	159 249	0,01
Pérou – Total		1 437 837	0,07	303 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.100%, 15/02/45	380 069	0,02
Pologne				275 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.000%, 12/04/52	176 304	0,01
2 425 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.250%, 25/07/25	600 414	0,03	Portugal – Total		9 269 416	0,46
2 410 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/26	577 401	0,03	Roumanie			
1 500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 0.250%, 25/10/26	335 453	0,02	500 000 RON	Romania Government Bond, 3.650%, 28/07/25	107 205	0,00
1 500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.750%, 25/05/27	367 595	0,02	1 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.850%, 22/04/26	216 363	0,01
1 620 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/27	380 808	0,02	500 000 RON	Romania Government Bond, 5.800%, 26/07/27	109 720	0,00
2 175 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/04/28	507 481	0,03	1 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.150%, 26/01/28	206 388	0,01
205 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 5.750%, 25/04/29	53 868	0,00	1 000 000 RON	Romania Government Bond, 5.000%, 12/02/29	210 105	0,01
2 580 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/10/29	586 125	0,03	1 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.150%, 24/10/30	197 014	0,01
2 500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.250%, 25/10/30	503 249	0,02	1 000 000 RON	Romania Government Bond, 3.650%, 24/09/31	186 995	0,01
3 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.750%, 25/04/32	593 271	0,03	1 500 000 RON	Romania Government Bond, 6.700%, 25/02/32	340 987	0,02
4 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 6.000%, 25/10/33	1 078 466	0,05	1 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.750%, 11/10/34	195 437	0,01
Pologne – Total		5 584 131	0,28	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 7.900%, 24/02/38	511 657	0,03
Portugal				Roumanie – Total		2 281 871	0,11
639 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.875%, 15/10/25	711 314	0,04	Singapour			
935 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.875%, 21/07/26	1 051 346	0,05	100 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.375%, 01/06/25	74 677	0,00
527 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.125%, 14/04/27	616 183	0,03	250 000 SGD	Singapore Government Bond, 0.500%, 01/11/25	180 261	0,01
550 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.700%, 15/10/27	574 579	0,03	390 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.125%, 01/06/26	289 152	0,01
697 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.125%, 17/10/28	766 353	0,04	300 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.250%, 01/11/26	217 078	0,01
582 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.950%, 15/06/29	631 701	0,03	579 000 SGD	Singapore Government Bond, 3.500%, 01/03/27	447 003	0,02
455 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 3.875%, 15/02/30	544 906	0,03	700 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/09/27	533 514	0,03
650 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.475%, 18/10/30	631 214	0,03	569 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.625%, 01/05/28	430 595	0,02
550 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.300%, 17/10/31	512 451	0,03	503 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/07/29	384 066	0,02
900 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.650%, 16/07/32	920 894	0,05	263 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/09/30	200 947	0,01
474 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.250%, 18/04/34	500 047	0,02	700 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.625%, 01/07/31	491 327	0,03
350 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.900%, 12/10/35	310 257	0,01	250 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.625%, 01/08/32	188 140	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Singapour (suite)				Slovénie (suite)			
277 000 SGD	Singapore Government Bond, 3.375%, 01/09/33	221 913	0,01	100 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.875%, 15/07/30	98 209	0,00
574 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.250%, 01/08/36	412 883	0,02	199 000 EUR	Slovenia Government Bond, 2.250%, 03/03/32	210 659	0,01
274 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.375%, 01/07/39	197 539	0,01	500 000 EUR	Slovenia Government Bond, 3.625%, 11/03/33	584 940	0,03
441 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.750%, 01/04/42	333 878	0,02	145 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.500%, 25/03/35	135 381	0,01
271 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.750%, 01/03/46	204 747	0,01	189 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.750%, 03/11/40	169 787	0,01
350 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.875%, 01/03/50	222 898	0,01	17 000 EUR	Slovenia Government Bond, 3.125%, 07/08/45	18 673	0,00
250 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.875%, 01/10/51	158 906	0,01	100 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.488%, 20/10/50	57 662	0,00
600 000 SGD	Singapore Government Bond, 3.000%, 01/08/72	486 868	0,02				
Singapour – Total		5 676 392	0,28	Slovénie – Total		1 858 448	0,09
Slovaquie				Espagne			
259 827 EUR	Slovakia Government Bond, 4.350%, 14/10/25	293 467	0,01	1 200 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/25	1 283 056	0,06
58 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.625%, 22/05/26	60 896	0,00	997 000 EUR	Spain Government Bond, 1.600%, 30/04/25	1 081 942	0,05
186 879 EUR	Slovakia Government Bond, 1.375%, 21/01/27	198 061	0,01	1 000 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/05/25	1 060 122	0,05
374 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.000%, 12/06/28	383 042	0,02	1 161 000 EUR	Spain Government Bond, 4.650%, 30/07/25	1 317 421	0,07
114 556 EUR	Slovakia Government Bond, 3.625%, 16/01/29	131 334	0,01	1 819 000 EUR	Spain Government Bond, 2.150%, 31/10/25	1 990 089	0,10
200 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.000%, 09/10/30	194 352	0,01	1 200 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/26	1 254 993	0,06
116 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.625%, 21/01/31	117 436	0,01	1 465 000 EUR	Spain Government Bond, 1.950%, 30/04/26	1 594 135	0,08
300 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.000%, 14/05/32	280 801	0,01	500 000 EUR	Spain Government Bond, 2.800%, 31/05/26	554 612	0,03
100 000 EUR	Slovakia Government Bond, 4.000%, 19/10/32	117 821	0,01	929 000 EUR	Spain Government Bond, 5.900%, 30/07/26	1 109 015	0,06
700 000 EUR	Slovakia Government Bond, 3.750%, 23/02/35	797 311	0,04	1 558 000 EUR	Spain Government Bond, 1.300%, 31/10/26	1 663 700	0,08
400 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.375%, 21/04/36	305 290	0,02	1 700 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/27	1 738 302	0,09
174 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.875%, 09/03/37	159 360	0,01	1 501 000 EUR	Spain Government Bond, 1.500%, 30/04/27	1 604 209	0,08
116 000 EUR	Slovakia Government Bond, 2.000%, 17/10/47	94 974	0,00	1 750 000 EUR	Spain Government Bond, 0.800%, 30/07/27	1 820 358	0,09
100 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.000%, 13/10/51	57 610	0,00	1 348 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 31/10/27	1 431 739	0,07
Slovaquie – Total		3 191 755	0,16	2 300 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/28	2 295 417	0,11
Slovénie				Slovénie			
116 000 EUR	Slovenia Government Bond, 2.125%, 28/07/25	126 695	0,01	1 390 000 EUR	Spain Government Bond, 1.400%, 30/04/28	1 465 416	0,07
42 000 EUR	Slovenia Government Bond, 5.125%, 30/03/26	48 675	0,00	1 375 000 EUR	Spain Government Bond, 1.400%, 30/07/28	1 445 622	0,07
161 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.250%, 22/03/27	169 915	0,01	1 800 000 EUR	Spain Government Bond, 5.150%, 31/10/28	2 222 024	0,11
232 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.188%, 14/03/29	237 852	0,01	1 639 476 EUR	Spain Government Bond, 6.000%, 31/01/29	2 105 089	0,10
				1 198 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 30/04/29	1 250 466	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Espagne (suite)				Espagne (suite)			
1 000 000 EUR	Spain Government Bond, 3.500%, 31/05/29	1 153 840	0,06	749 000 EUR	Spain Government Bond, 3.450%, 30/07/66	775 796	0,04
1 500 000 EUR	Spain Government Bond, 0.800%, 30/07/29	1 502 827	0,07	400 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 31/10/71	223 298	0,01
1 448 000 EUR	Spain Government Bond, 0.600%, 31/10/29	1 427 392	0,07	Espagne – Total			66 546 377
1 340 000 EUR	Spain Government Bond, 0.500%, 30/04/30	1 296 460	0,06	Suède			
1 825 000 EUR	Spain Government Bond, 1.950%, 30/07/30	1 928 553	0,10	4 470 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.750%, 12/05/28	419 702	0,02
1 500 000 EUR	Spain Government Bond, 1.250%, 31/10/30	1 507 963	0,08	4 110 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.750%, 12/11/29	380 068	0,02
1 500 000 EUR	Spain Government Bond, 0.100%, 30/04/31	1 370 203	0,07	3 250 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.125%, 12/05/31	282 230	0,02
1 250 000 EUR	Spain Government Bond, 0.500%, 31/10/31	1 161 415	0,06	3 900 000 SEK	Sweden Government Bond, 2.250%, 01/06/32	394 564	0,02
1 350 000 EUR	Spain Government Bond, 0.700%, 30/04/32	1 258 445	0,06	2 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 1.750%, 11/11/33	193 377	0,01
1 505 000 EUR	Spain Government Bond, 5.750%, 30/07/32	2 029 528	0,10	2 635 000 SEK	Sweden Government Bond, 3.500%, 30/03/39	304 933	0,02
1 400 000 EUR	Spain Government Bond, 2.550%, 31/10/32	1 507 909	0,08	1 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.500%, 24/11/45	69 646	0,00
1 450 000 EUR	Spain Government Bond, 3.150%, 30/04/33	1 628 428	0,08	1 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 1.375%, 23/06/71	67 496	0,00
1 095 000 EUR	Spain Government Bond, 2.350%, 30/07/33	1 150 310	0,06	2 000 000 SEK	Sweden Government International Bond, 0.125%, perpetual	175 776	0,01
1 800 000 EUR	Spain Government Bond, 3.550%, 31/10/33	2 082 480	0,10	Suède – Total			2 287 792
1 164 000 EUR	Spain Government Bond, 1.850%, 30/07/35	1 130 602	0,06	Suisse			
1 320 000 EUR	Spain Government Bond, 4.200%, 31/01/37	1 613 663	0,08	250 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.250%, 28/05/26	299 032	0,01
1 100 000 EUR	Spain Government Bond, 0.850%, 30/07/37	896 099	0,04	250 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 3.250%, 27/06/27	321 443	0,02
1 100 000 EUR	Spain Government Bond, 3.900%, 30/07/39	1 287 888	0,06	484 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.010%, 22/06/29	552 616	0,03
759 000 EUR	Spain Government Bond, 4.900%, 30/07/40	993 824	0,05	302 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 27/05/30	354 108	0,02
650 000 EUR	Spain Government Bond, 1.200%, 31/10/40	515 354	0,03	146 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.250%, 22/06/31	192 928	0,01
609 000 EUR	Spain Government Bond, 4.700%, 30/07/41	787 460	0,04	45 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 27/06/32	52 509	0,00
950 000 EUR	Spain Government Bond, 1.000%, 30/07/42	702 501	0,04	122 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 3.500%, 08/04/33	181 328	0,01
1 200 000 EUR	Spain Government Bond, 3.450%, 30/07/43	1 314 233	0,07	100 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.010%, 26/06/34	110 504	0,01
814 000 EUR	Spain Government Bond, 5.150%, 31/10/44	1 119 737	0,06	187 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.500%, 08/03/36	269 287	0,01
922 000 EUR	Spain Government Bond, 2.900%, 31/10/46	921 171	0,05	170 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.250%, 27/06/37	216 992	0,01
1 353 000 EUR	Spain Government Bond, 2.700%, 31/10/48	1 286 619	0,06	100 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.500%, 26/10/38	132 704	0,01
1 170 000 EUR	Spain Government Bond, 1.000%, 31/10/50	728 536	0,04	350 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.010%, 24/07/39	375 159	0,02
1 250 000 EUR	Spain Government Bond, 1.900%, 31/10/52	956 116	0,05	364 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.500%, 30/04/42	495 324	0,02
				300 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.250%, 28/06/43	395 819	0,02
				787 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 28/06/45	909 709	0,04

Tableau des investissements (suite)
au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
Suisse (suite)				Royaume-Uni			
42 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 4.000%, 06/01/49	88 931	0,00	2 100 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.250%, 31/01/25	2 562 393	0,13
102 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 24/05/55	119 107	0,01	1 894 040 GBP	United Kingdom Gilt, 5.000%, 07/03/25	2 435 697	0,12
116 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 30/05/58	138 559	0,01	1 750 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.625%, 07/06/25	2 125 958	0,11
91 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.000%, 25/06/64	170 125	0,01	2 332 912 GBP	United Kingdom Gilt, 2.000%, 07/09/25	2 884 389	0,14
Suisse – Total		5 376 184	0,27	1 300 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.500%, 22/10/25	1 644 114	0,08
Thaïlande				1 900 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.125%, 30/01/26	2 252 716	0,11
18 000 000 THB	Thailand Government Bond, 1.450%, 17/12/24	523 032	0,03	2 390 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.500%, 22/07/26	2 897 418	0,15
9 200 000 THB	Thailand Government Bond, 3.850%, 12/12/25	277 217	0,01	1 750 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.375%, 22/10/26	2 045 400	0,10
15 250 000 THB	Thailand Government Bond, 2.350%, 17/06/26	446 761	0,02	2 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.125%, 29/01/27	2 589 246	0,13
19 100 000 THB	Thailand Government Bond, 2.125%, 17/12/26	555 930	0,03	2 224 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.250%, 22/07/27	2 632 639	0,13
25 500 000 THB	Thailand Government Bond, 1.000%, 17/06/27	712 274	0,04	1 647 635 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/27	2 166 105	0,11
18 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.650%, 17/06/28	532 087	0,03	1 900 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.125%, 31/01/28	2 125 918	0,11
20 900 000 THB	Thailand Government Bond, 2.875%, 17/12/28	624 309	0,03	2 600 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.500%, 07/06/28	3 456 504	0,17
11 600 000 THB	Thailand Government Bond, 4.875%, 22/06/29	380 390	0,02	2 219 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.625%, 22/10/28	2 619 649	0,13
34 000 000 THB	Thailand Government Bond, 1.600%, 17/12/29	946 691	0,05	872 689 GBP	United Kingdom Gilt, 6.000%, 07/12/28	1 245 170	0,06
750 000 THB	Thailand Government Bond, 3.650%, 20/06/31	23 464	0,00	2 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.500%, 31/01/29	2 213 996	0,11
38 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.000%, 17/12/31	1 057 610	0,05	3 074 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.875%, 22/10/29	3 422 583	0,17
10 600 000 THB	Thailand Government Bond, 3.775%, 25/06/32	336 340	0,02	2 300 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.375%, 22/10/30	2 401 487	0,12
10 000 000 THB	Thailand Government Bond, 1.600%, 17/06/35	259 336	0,01	1 955 114 GBP	United Kingdom Gilt, 4.750%, 07/12/30	2 697 227	0,14
10 000 000 THB	Thailand Government Bond, 1.585%, 17/12/35	258 566	0,01	3 200 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.250%, 31/07/31	3 226 895	0,16
11 050 000 THB	Thailand Government Bond, 3.400%, 17/06/36	335 529	0,02	2 350 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.000%, 31/01/32	2 483 801	0,12
6 400 000 THB	Thailand Government Bond, 4.260%, 12/12/37	209 608	0,01	1 940 897 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/06/32	2 620 409	0,13
13 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.300%, 17/06/38	392 577	0,02	1 500 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.250%, 31/01/33	1 871 183	0,09
32 500 000 THB	Thailand Government Bond, 3.450%, 17/06/43	994 258	0,05	1 450 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.875%, 31/07/33	1 448 065	0,07
16 250 000 THB	Thailand Government Bond, 4.675%, 29/06/44	577 344	0,03	1 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.625%, 31/01/34	1 383 884	0,07
16 200 000 THB	Thailand Government Bond, 2.875%, 17/06/46	432 859	0,02	1 947 911 GBP	United Kingdom Gilt, 4.500%, 07/09/34	2 666 729	0,13
4 050 000 THB	Thailand Government Bond, 4.850%, 17/06/61	143 854	0,01	2 200 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.625%, 31/07/35	1 995 079	0,10
16 100 000 THB	Thailand Government Bond, 4.000%, 17/06/66	488 073	0,02	1 670 420 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/03/36	2 232 623	0,11
3 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.600%, 17/06/67	82 243	0,00	2 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.750%, 07/09/37	1 980 325	0,10
Thaïlande – Total		10 590 352	0,53				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)				
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)				
1 100 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.750%, 29/01/38	1 374 416	0,07	1 995 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.625%, 22/10/71	1 312 355	0,07	
1 304 786 GBP	United Kingdom Gilt, 4.750%, 07/12/38	1 814 372	0,09	950 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.125%, 22/10/73	507 373	0,03	
1 100 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.125%, 31/01/39	954 055	0,05	Royaume-Uni – Total			109 745 225	5,48
1 422 802 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/09/39	1 866 641	0,09	États-Unis				
1 566 282 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/40	2 047 951	0,10	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.000%, 15/12/24	2 892 891	0,14	
2 750 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.250%, 22/10/41	2 276 846	0,11	1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 31/12/24	1 455 645	0,07	
1 290 515 GBP	United Kingdom Gilt, 4.500%, 07/12/42	1 735 401	0,09	1 654 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 31/12/24	1 613 038	0,08	
800 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.750%, 22/10/43	1 104 446	0,06	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 31/12/24	2 486 816	0,12	
1 897 699 GBP	United Kingdom Gilt, 3.250%, 22/01/44	2 132 295	0,11	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/01/25	3 371 758	0,17	
1 443 529 GBP	United Kingdom Gilt, 3.500%, 22/01/45	1 676 873	0,08	1 850 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/01/25	1 785 250	0,09	
1 500 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.875%, 31/01/46	1 022 912	0,05	1 971 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 31/01/25	1 924 805	0,10	
994 043 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/46	1 284 693	0,06	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/01/25	2 981 367	0,15	
1 855 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.500%, 22/07/47	1 435 027	0,07	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 15/02/25	2 412 793	0,12	
1 324 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.750%, 22/01/49	1 068 011	0,05	2 485 300 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/02/25	2 411 906	0,12	
1 178 541 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/49	1 528 110	0,08	106 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 7.625%, 15/02/25	110 454	0,01	
1 250 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.625%, 22/10/50	703 817	0,04	1 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 28/02/25	1 632 598	0,08	
1 700 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.250%, 31/07/51	1 154 988	0,06	967 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 28/02/25	946 149	0,05	
1 374 937 GBP	United Kingdom Gilt, 3.750%, 22/07/52	1 646 744	0,08	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 28/02/25	2 498 047	0,12	
1 250 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.500%, 31/07/53	888 758	0,04	2 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 15/03/25	2 657 617	0,13	
2 050 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.750%, 22/10/53	2 441 669	0,12	2 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/03/25	2 139 346	0,11	
1 332 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.625%, 22/10/54	972 328	0,05	742 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/03/25	724 493	0,04	
1 254 359 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/55	1 640 232	0,08	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 31/03/25	2 973 867	0,15	
2 168 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.750%, 22/07/57	1 612 381	0,08	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 15/04/25	3 413 730	0,17	
1 398 767 GBP	United Kingdom Gilt, 4.000%, 22/01/60	1 759 753	0,09	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 30/04/25	2 365 918	0,12	
800 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.500%, 22/10/61	343 727	0,02	1 532 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 30/04/25	1 498 547	0,07	
550 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.000%, 22/10/63	692 824	0,04	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/04/25	2 477 539	0,12	
1 192 000 GBP	United Kingdom Gilt, 2.500%, 22/07/65	1 065 288	0,05	2 402 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.125%, 15/05/25	2 325 342	0,12	
1 181 099 GBP	United Kingdom Gilt, 3.500%, 22/07/68	1 353 337	0,07	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/05/25	2 928 281	0,15	
				2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/05/25	2 354 102	0,12	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
1 090 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 31/05/25	1 065 092	0,05	800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/12/25	775 438	0,04
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 31/05/25	4 981 445	0,25	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/01/26	3 474 023	0,17
4 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/06/25	4 154 043	0,21	3 400 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 31/01/26	3 141 016	0,16
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 30/06/25	1 878 594	0,09	1 345 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/01/26	1 302 969	0,07
625 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 30/06/25	609 766	0,03	2 977 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/02/26	2 821 638	0,14
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 30/06/25	2 004 844	0,10	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 15/02/26	3 484 687	0,17
5 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/07/25	5 380 332	0,27	227 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.000%, 15/02/26	235 075	0,01
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/07/25	1 872 969	0,09	3 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 28/02/26	2 957 250	0,15
1 590 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 31/07/25	1 552 051	0,08	1 445 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 28/02/26	1 394 764	0,07
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 31/07/25	3 013 945	0,15	5 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 15/03/26	5 549 414	0,28
3 456 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/08/25	3 325 860	0,17	3 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/03/26	3 016 406	0,15
2 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/08/25	2 695 107	0,13	1 242 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 31/03/26	1 191 544	0,06
113 100 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.875%, 15/08/25	117 138	0,01	1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 15/04/26	1 486 406	0,07
2 450 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/08/25	2 287 592	0,11	3 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 30/04/26	2 961 250	0,15
858 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 31/08/25	835 310	0,04	1 477 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 30/04/26	1 419 535	0,07
1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.000%, 31/08/25	1 514 004	0,08	2 099 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/05/26	1 980 931	0,10
2 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 15/09/25	2 660 449	0,13	500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/05/26	494 375	0,02
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 30/09/25	2 328 320	0,12	3 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/05/26	3 001 172	0,15
1 532 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 30/09/25	1 496 932	0,07	1 472 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.125%, 31/05/26	1 405 760	0,07
3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 15/10/25	3 493 848	0,17	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 15/06/26	3 000 469	0,15
2 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/10/25	2 554 600	0,13	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.875%, 30/06/26	2 774 766	0,14
1 034 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 31/10/25	1 010 048	0,05	1 042 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 30/06/26	988 353	0,05
3 209 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/11/25	3 090 919	0,15	3 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 31/07/26	2 977 559	0,15
3 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/11/25	3 211 125	0,16	1 122 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 31/07/26	1 061 780	0,05
2 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 30/11/25	2 089 775	0,10	2 378 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 15/08/26	2 226 031	0,11
2 492 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 30/11/25	2 427 850	0,12	110 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.750%, 15/08/26	116 823	0,01
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.875%, 30/11/25	3 031 523	0,15	1 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/08/26	1 605 078	0,08
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 15/12/25	2 487 109	0,12	1 542 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/08/26	1 437 915	0,07
2 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 31/12/25	2 549 014	0,13	2 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.875%, 30/09/26	2 021 422	0,10

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 30/09/26	937 891	0,05	4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 31/08/27	3 890 000	0,19
3 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 31/10/26	2 999 902	0,15	2 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 30/09/27	2 457 656	0,12
1 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 31/10/26	1 170 605	0,06	2 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 30/09/27	2 265 293	0,11
2 160 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/11/26	2 043 056	0,10	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/10/27	3 079 727	0,15
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 15/11/26	5 080 859	0,25	4 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/10/27	4 782 656	0,24
144 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.500%, 15/11/26	154 035	0,01	2 640 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/11/27	2 483 662	0,12
3 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/11/26	3 005 996	0,15	170 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.125%, 15/11/27	184 105	0,01
1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 30/11/26	1 402 500	0,07	2 650 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 30/11/27	2 337 176	0,12
3 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 31/12/26	3 508 766	0,18	4 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/11/27	4 492 969	0,22
850 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 31/12/26	796 676	0,04	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 31/12/27	2 497 852	0,12
3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 31/01/27	3 250 625	0,16	4 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/01/28	3 705 516	0,19
3 831 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/02/27	3 637 954	0,18	2 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 31/01/28	2 757 781	0,14
101 600 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.625%, 15/02/27	109 085	0,01	3 133 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/02/28	2 996 176	0,15
1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 28/02/27	1 374 492	0,07	9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 29/02/28	8 499 531	0,42
2 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 28/02/27	2 579 199	0,13	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 29/02/28	3 514 219	0,18
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 31/03/27	899 141	0,05	1 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 31/03/28	1 570 762	0,08
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 31/03/27	3 824 688	0,19	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 31/03/28	2 969 531	0,15
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 30/04/27	2 679 375	0,13	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/04/28	3 136 055	0,16
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 30/04/27	2 406 055	0,12	1 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 30/04/28	1 674 500	0,08
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/05/27	1 900 625	0,09	1 622 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/28	1 556 740	0,08
1 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/05/27	1 559 004	0,08	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 31/05/28	1 788 281	0,09
3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/05/27	3 352 070	0,17	1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 31/05/28	1 485 586	0,07
3 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 30/06/27	2 843 750	0,14	2 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/06/28	2 499 000	0,12
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.250%, 30/06/27	2 444 141	0,12	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 30/06/28	3 016 875	0,15
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 31/07/27	2 206 445	0,11	3 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.000%, 31/07/28	3 300 586	0,16
5 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 31/07/27	5 283 008	0,26	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/07/28	2 022 500	0,10
1 673 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/08/27	1 578 371	0,08	3 760 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/08/28	3 601 375	0,18
153 100 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.375%, 15/08/27	165 085	0,01	188 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.500%, 15/08/28	201 872	0,01
1 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/08/27	1 547 246	0,08	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 31/08/28	3 092 852	0,15

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
4 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 31/08/28	4 293 844	0,21	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 28/02/30	3 018 984	0,15
3 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/09/28	2 882 598	0,14	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 31/03/30	1 972 031	0,10
1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 30/09/28	1 549 805	0,08	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 30/04/30	2 936 953	0,15
3 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/10/28	2 895 801	0,14	3 100 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 15/05/30	2 537 641	0,13
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.875%, 31/10/28	3 134 297	0,16	294 500 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.250%, 15/05/30	332 969	0,02
2 934 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/11/28	2 837 728	0,14	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 31/05/30	1 985 312	0,10
3 241 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.250%, 15/11/28	3 435 401	0,17	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 30/06/30	1 985 312	0,10
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 30/11/28	2 685 000	0,13	500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 31/07/30	503 594	0,03
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 30/11/28	5 121 875	0,26	4 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 15/08/30	3 819 484	0,19
3 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/12/28	3 330 469	0,17	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/08/30	2 028 437	0,10
4 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 31/01/29	4 290 215	0,21	1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 30/09/30	1 044 063	0,05
4 157 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 15/02/29	3 918 947	0,20	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.875%, 31/10/30	2 119 062	0,11
177 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.250%, 15/02/29	188 643	0,01	6 050 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.875%, 15/11/30	4 978 961	0,25
2 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 28/02/29	2 496 484	0,12	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 30/11/30	3 090 469	0,15
3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 31/03/29	3 253 086	0,16	5 900 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/02/31	4 933 875	0,25
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 30/04/29	2 381 250	0,12	576 700 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.375%, 15/02/31	630 946	0,03
2 585 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/05/29	2 399 809	0,12	4 850 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/05/31	4 167 211	0,21
3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 31/05/29	3 309 414	0,17	5 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 15/08/31	4 354 219	0,22
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.250%, 30/06/29	2 423 437	0,12	6 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 15/11/31	5 240 812	0,26
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/07/29	2 813 437	0,14	5 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 15/02/32	4 996 156	0,25
2 566 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/08/29	2 286 747	0,11	6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/32	6 034 844	0,30
142 100 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.125%, 15/08/29	157 687	0,01	6 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/08/32	6 240 062	0,31
2 100 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 31/08/29	2 019 937	0,10	5 450 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 15/11/32	5 551 336	0,28
1 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/09/29	1 749 180	0,09	5 950 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 15/02/33	5 781 727	0,29
1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 31/10/29	1 509 375	0,08	5 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, 15/05/33	5 578 875	0,28
1 550 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 15/11/29	1 385 434	0,07	6 050 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/08/33	6 054 727	0,30
1 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/11/29	1 749 453	0,09	4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/11/33	4 208 125	0,21
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 31/01/30	1 959 062	0,10	1 033 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/02/36	1 104 180	0,06
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 15/02/30	2 617 500	0,13	348 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 15/02/37	381 767	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
66 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.000%, 15/05/37	73 992	0,00	2 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 15/11/42	2 292 352	0,11
681 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/02/38	717 710	0,04	1 454 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/02/43	1 248 259	0,06
393 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/05/38	418 791	0,02	1 850 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/02/43	1 770 508	0,09
696 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 15/02/39	660 983	0,03	1 647 100 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/43	1 357 056	0,07
439 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 15/05/39	453 679	0,02	1 400 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/05/43	1 339 844	0,07
284 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/08/39	301 484	0,02	711 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/08/43	656 009	0,03
704 400 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/11/39	735 988	0,04	2 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/08/43	2 868 687	0,14
1 045 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 15/02/40	1 123 199	0,06	839 600 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 15/11/43	786 994	0,04
2 550 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/05/40	1 649 531	0,08	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 15/11/43	2 690 625	0,13
529 300 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/05/40	551 382	0,03	2 090 800 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/02/44	1 921 576	0,10
2 900 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/08/40	1 857 812	0,09	775 100 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, 15/05/44	685 600	0,03
512 700 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/08/40	501 485	0,03	1 955 500 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/08/44	1 660 647	0,08
3 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 15/11/40	2 197 594	0,11	1 054 400 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/11/44	875 482	0,04
634 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 15/11/40	648 166	0,03	2 026 400 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 15/02/45	1 539 747	0,08
3 650 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 15/02/41	2 634 273	0,13	1 653 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/05/45	1 368 116	0,07
711 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 15/02/41	771 213	0,04	1 384 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/08/45	1 119 742	0,06
3 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/05/41	2 751 750	0,14	318 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/11/45	262 499	0,01
798 100 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/05/41	825 285	0,04	1 656 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 15/02/46	1 246 916	0,06
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 15/08/41	2 791 875	0,14	1 141 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 15/05/46	857 355	0,04
1 189 300 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 15/08/41	1 135 596	0,06	1 282 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/08/46	915 228	0,05
4 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/11/41	3 157 828	0,16	875 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/11/46	703 281	0,04
666 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/11/41	580 981	0,03	1 562 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/02/47	1 281 816	0,06
3 150 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/02/42	2 425 992	0,12	1 390 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/05/47	1 140 017	0,06
570 100 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/02/42	495 720	0,02	1 798 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/08/47	1 406 373	0,07
492 600 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/05/42	418 248	0,02	2 280 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/11/47	1 782 675	0,09
3 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.250%, 15/05/42	2 862 539	0,14	2 028 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/02/48	1 659 474	0,08
438 900 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/08/42	357 086	0,02	2 191 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/05/48	1 832 908	0,09
3 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, 15/08/42	2 864 000	0,14	2 404 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/08/48	1 965 270	0,10
725 700 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/11/42	588 611	0,03	2 357 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, 15/11/48	2 062 375	0,10

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,40 % (suite)				Obligations d'État – 98,40 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
2 190 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/02/49	1 789 983	0,09	3 650 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/52	2 919 430	0,15
2 687 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/49	2 144 982	0,11	3 450 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/08/52	2 834 391	0,14
2 850 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/08/49	1 999 008	0,10	3 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 15/11/52	3 319 641	0,17
2 270 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/11/49	1 635 464	0,08	3 850 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/02/53	3 571 477	0,18
3 150 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/02/50	2 082 445	0,10	3 950 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/05/53	3 669 180	0,18
3 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 15/05/50	1 815 281	0,09	2 400 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 15/08/53	2 437 500	0,12
3 850 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 15/08/50	2 156 000	0,11	1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 15/11/53	1 690 078	0,08
4 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/11/50	2 693 672	0,13	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, perpetual	3 079 180	0,15
4 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 15/02/51	2 773 125	0,14	1 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, perpetual	1 249 609	0,06
4 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/05/51	3 405 898	0,17				
4 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/08/51	3 018 031	0,15				
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 15/11/51	2 540 625	0,13				
3 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/02/52	2 507 625	0,13				
				États-Unis – Total		636 878 129	31,78
				Total des obligations d'État		1 972 152 465	98,40
				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé		1 972 152 465	98,40
				TOTAL DES INVESTISSEMENTS		1 972 152 465	98,40

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – (0,58) %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold GBP, due 04/01/24	Citibank NA	211 000	110 668	2 900	0,00
Bought AUD / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	138 000	122 162	1 553	0,00
Bought AUD / Sold USD, due 04/01/24	Citibank NA	282 000	186 792	5 637	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	21 609 000	14 792 641	47 043	0,00
Bought CAD / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	11 764 000	6 993 223	6 863	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	3 517 000	2 665 567	1 741	0,00
Bought CHF / Sold AUD, due 04/01/24	UBS AG	78 752	136 000	766	0,00
Bought CHF / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	89 034	153 000	1 627	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 04/01/24	Bank of Montreal	3 215	5 000	28	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 04/01/24	UBS AG	90 117	140 000	895	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	104 984	163 000	1 474	0,00
Bought CHF / Sold CLP, due 04/01/24	UBS AG	1 135	1 128 000	57	0,00
Bought CHF / Sold CLP, due 05/02/24	UBS AG	1 123	1 128 000	50	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	7 684	63 000	246	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 135	34 000	119	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	11 102	91 000	358	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	UBS AG	488 859	3 982 000	19 315	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	62 587	520 000	1 051	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 05/02/24	UBS AG	496 535	4 170 000	2 037	0,00
Bought CHF / Sold COP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	8 915	41 010 000	113	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold CZK, due 04/01/24	UBS AG	14 685	372 000	804	0,00
Bought CHF / Sold CZK, due 05/02/24	UBS AG	14 149	372 000	240	0,00
Bought CHF / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	12 115	94 000	464	0,00
Bought CHF / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	11 878	94 000	208	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	19 802	21 000	329	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 398 414	2 541 917	41 621	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	633 648	659 500	24 319	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	668 580	696 500	24 949	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	659 658	701 000	11 018	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	653 172	694 000	11 028	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	163 957	174 000	2 995	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	4 398	4 000	126	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 130 000	1 039 424	17 538	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	Citibank NA	10 992	10 000	312	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	294 665	266 000	11 006	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	21 000	19 112	586	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 05/02/24	BNP Paribas SA	40 180	37 000	722	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 05/02/24	Goldman Sachs International	303 127	280 000	4 348	0,00
Bought CHF / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	6 146	2 429 000	284	0,00
Bought CHF / Sold HUF, due 05/02/24	UBS AG	5 957	2 429 000	113	0,00
Bought CHF / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	46 935	832 653 000	1 687	0,00
Bought CHF / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	46 279	832 653 000	1 107	0,00
Bought CHF / Sold IDR, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	5 822	105 328 000	101	0,00
Bought CHF / Sold ILS, due 04/01/24	UBS AG	9 284	39 000	200	0,00
Bought CHF / Sold ILS, due 05/02/24	UBS AG	9 162	39 000	84	0,00
Bought CHF / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	565 895	94 416 501	1 622	0,00
Bought CHF / Sold JPY, due 05/02/24	Citibank NA	142 324	23 687 000	828	0,00
Bought CHF / Sold JPY, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	565 939	94 416 500	1 675	0,00
Bought CHF / Sold KRW, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	6 712	10 084 000	144	0,00
Bought CHF / Sold KRW, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	102 862	151 924 000	4 244	0,00
Bought CHF / Sold KRW, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	107 118	162 008 000	1 672	0,00
Bought CHF / Sold KRW, due 05/02/24	UBS AG	13 643	20 636 000	211	0,00
Bought CHF / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	33 807	669 000	668	0,00
Bought CHF / Sold MXN, due 06/02/24	BNP Paribas SA	4 485	90 000	62	0,00
Bought CHF / Sold MXN, due 06/02/24	UBS AG	33 351	669 000	471	0,00
Bought CHF / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	33 879	180 000	1 077	0,00
Bought CHF / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	33 230	180 000	354	0,00
Bought CHF / Sold NOK, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	4 276	51 000	71	0,00
Bought CHF / Sold NZD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	2 685	5 000	24	0,00
Bought CHF / Sold NZD, due 04/01/24	UBS AG	9 676	18 000	100	0,00
Bought CHF / Sold NZD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	12 372	23 000	184	0,00
Bought CHF / Sold PEN, due 04/01/24	Merrill Lynch International	1 411	6 000	56	0,00

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold PEN, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	1 388	6 000	36	0,00
Bought CHF / Sold PLN, due 04/01/24	UBS AG	17 903	81 000	672	0,00
Bought CHF / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	17 553	81 000	336	0,00
Bought CHF / Sold RON, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	8 293	43 000	306	0,00
Bought CHF / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	8 128	43 000	144	0,00
Bought CHF / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	5 327	63 000	77	0,00
Bought CHF / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	8 423	99 000	205	0,00
Bought CHF / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	351 385	544 389	4 778	0,00
Bought CHF / Sold SGD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	18 027	28 000	232	0,00
Bought CHF / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	30 294	1 207 000	629	0,00
Bought CHF / Sold THB, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	29 842	1 207 000	110	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	609 329	697 000	26 970	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	385 730	452 253	6 049	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	581 074	665 000	25 398	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	628 377	719 000	27 602	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	603 476	710 334	9 066	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	231 414	270 000	5 867	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Goldman Sachs International	593 992	699 333	8 763	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	594 566	699 333	9 446	0,00
Bought CNH / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	83 454 000	9 187 933	8 113	0,00
Bought CNY / Sold EUR, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	620 384 000	78 323 402	959 846	0,05
Bought CNY / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	253 759 000	27 937 796	168 404	0,01
Bought CNY / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	94 732 000	17 509 615	85 962	0,01
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	681 000	95 324	707	0,00
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 772 000	248 749	1 129	0,00
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	95 458 000	13 348 495	112 463	0,01
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 112 000	294 596	3 227	0,00
Bought COP / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	5 640 429 000	1 306 044	12 909	0,00
Bought COP / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	3 011 659 000	601 141	10 913	0,00
Bought COP / Sold SGD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	853 804 000	289 177	1 117	0,00
Bought COP / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 647 662 000	418 850	6 380	0,00
Bought CZK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	63 923 000	2 587 484	1 682	0,00
Bought CZK / Sold GBP, due 04/01/24	Merrill Lynch International	1 812 000	63 581	20	0,00
Bought DKK / Sold GBP, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	162 000	18 657	223	0,00
Bought DKK / Sold USD, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	658 000	95 645	1 865	0,00
Bought EUR / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	12 262 528	19 842 000	9 575	0,00
Bought EUR / Sold CLP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	757 965	726 183 000	5 782	0,00
Bought EUR / Sold CLP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	763 856	726 183 000	14 935	0,00
Bought EUR / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	3 532 250	27 498 000	24 434	0,00
Bought EUR / Sold CNY, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	73 787 471	577 339 000	99 314	0,01
Bought EUR / Sold CNY, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	2 010 765	15 547 000	28 926	0,00
Bought EUR / Sold CZK, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	475 104	11 622 000	4 850	0,00
Bought EUR / Sold CZK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 148 916	52 301 000	33 829	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 926 958	14 363 000	219	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 197 434	1 896 000	10 455	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	1 774 800	1 523 000	19 078	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	44 259 873	38 338 920	18 842	0,00
Bought EUR / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	950 619	360 861 000	7 359	0,00
Bought EUR / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	7 286 194	123 879 858 000	15 838	0,00
Bought EUR / Sold KRW, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	16 325 389	23 175 849 000	38 267	0,00
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought EUR / Sold KRW, due 04/01/24	London	910 990	1 291 001 000	3 890	0,00
Bought EUR / Sold PEN, due 04/01/24	Standard Chartered Bank	630 205	2 573 000	1 289	0,00
Bought EUR / Sold PEN, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	629 678	2 573 000	2 210	0,00
Bought EUR / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 022 040	13 136 000	3 543	0,00
Bought EUR / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	1 383 304	6 893 000	10	0,00
Bought EUR / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 215 827	13 454 000	8 032	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	112 243 158	123 302 010	692 156	0,04
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	13 638 032	14 902 518	163 313	0,01
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	International	103 386 330	113 734 842	475 252	0,03
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	87 576 292	96 256 766	488 099	0,03
	Westpac Banking				
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Corporation	703 000	757 843	18 756	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	610 311	671 000	4 049	0,00
Bought GBP / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	5 775 765	10 755 000	17 738	0,00
Bought GBP / Sold CLP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	194 401	213 441 000	3 418	0,00
Bought GBP / Sold CLP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	154 031	169 818 000	2 310	0,00
Bought GBP / Sold CNH, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	63 065	569 000	481	0,00
Bought GBP / Sold CNH, due 04/01/24	BNP Paribas SA	8 824 447	79 687 000	57 580	0,00
	Westpac Banking				
Bought GBP / Sold CNH, due 04/01/24	Corporation	354 380	3 198 000	2 613	0,00
Bought GBP / Sold CNY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	691 260	6 211 000	5 383	0,00
Bought GBP / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	27 073 722	244 462 000	41 081	0,00
	Westpac Banking				
Bought GBP / Sold CNY, due 04/01/24	Corporation	399 629	3 589 000	3 350	0,00
Bought GBP / Sold CZK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 084 756	30 470 000	19 559	0,00
Bought GBP / Sold CZK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 209 668	34 472 000	1 605	0,00
Bought GBP / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	788 654	6 783 000	197	0,00
Bought GBP / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	771 993	6 621 000	1 560	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	44 917 351	51 743 437	100 346	0,01
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	49 607 958	56 967 000	241 890	0,01
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	253 349	292 000	54	0,00
	Goldman Sachs				
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	International	49 571 829	56 967 000	195 826	0,01
Bought GBP / Sold HUF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	452 736	198 450 000	3 688	0,00
Bought GBP / Sold HUF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	448 411	198 450 000	774	0,00
Bought GBP / Sold IDR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	439 320	8 601 881 000	1 381	0,00
Bought GBP / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	2 963 776	58 014 168 000	10 563	0,00
Bought GBP / Sold KRW, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	7 267 981	11 843 539 000	71 114	0,00
	Goldman Sachs				
Bought GBP / Sold MYR, due 04/01/24	International	2 796 636	16 329 000	11 017	0,00
Bought GBP / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	392 198	5 071 000	327	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought GBP / Sold PEN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	175 056	818 000	2 245	0,00
Bought GBP / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 385 521	6 931 000	4 780	0,00
Bought GBP / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	598 286	3 432 000	1 037	0,00
Bought GBP / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	559 699	7 128 000	5 410	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	43 700 190	55 359 668	349 620	0,02
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 627 335	5 850 496	48 460	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	40 022 630	50 769 666	251 441	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	6 469 100	8 225 525	21 325	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	3 809 571	4 809 000	47 467	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	40 026 637	50 769 666	256 550	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	4 505 710	5 673 684	70 222	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	45 304 015	57 585 999	177 963	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	358 295	454 000	2 836	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	Goldman Sachs International	45 143 955	57 445 999	113 881	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada Westpac Banking Corporation	45 179 143	57 446 002	158 744	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	360 861 000	943 650	4 200	0,00
Bought HUF / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	66 616 049 000	3 384 790	11 393	0,00
Bought IDR / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	19 635 626 000	1 266 422	8 854	0,00
Bought IDR / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	6 177 000	1 541 349	12 705	0,00
Bought ILS / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 057 000	878 752	6 435	0,00
Bought ILS / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	1 291 000	471 367	1 168	0,00
Bought ILS / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	1 123 000	310 221	1 648	0,00
Bought ILS / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	13 992 138 000	88 821 771	1 128 363	0,06
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	99 677 000	637 741	2 521	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	13 992 138 000	88 833 331	1 115 592	0,06
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	49 454 000	267 916	9 245	0,00
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	7 745 883 501	42 752 420	442 075	0,03
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	Merrill Lynch International	7 745 883 500	42 735 909	463 123	0,03
Bought JPY / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 144 198 000	19 897 176	124 627	0,01
Bought JPY / Sold SGD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	2 144 198 000	19 904 997	118 697	0,01
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	53 831 000	377 672	4 163	0,00
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 229 140 000	15 638 103	173 644	0,01
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada Westpac Banking Corporation	2 149 113 000	15 076 205	167 894	0,01
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	95 657 000	664 545	13 969	0,00
Bought KRW / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	24 466 850 000	17 101 433	106 917	0,01
Bought KRW / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	12 855 622 000	7 754 249	94 882	0,00
Bought KRW / Sold SGD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	3 608 224 000	3 680 059	8 930	0,00
Bought KRW / Sold USD, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	3 851 872 000	2 949 027	41 988	0,00
Bought MXN / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	107 052 000	5 704 431	18 910	0,00
Bought MXN / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	56 740 000	2 624 575	4 212	0,00
Bought MXN / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	16 924 000	998 380	845	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought MYR / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	29 645 000	5 798 874	46 018	0,00
Bought MYR / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 417 000	240 904	1 352	0,00
Bought MYR / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	14 912 000	2 516 453	37 701	0,00
Bought MYR / Sold SGD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	4 091 000	1 163 869	8 239	0,00
Bought MYR / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	4 842 000	1 036 942	16 879	0,00
Bought NOK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	10 911 000	971 657	1 018	0,00
Bought NZD / Sold EUR, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	3 394 000	1 943 315	2 145	0,00
Bought NZD / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 879 000	932 663	723	0,00
Bought NZD / Sold GBP, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	104 000	50 797	1 091	0,00
Bought NZD / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	544 000	344 026	408	0,00
Bought PEN / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	818 000	172 867	546	0,00
Bought PEN / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 006 000	270 818	874	0,00
Bought PLN / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	578 000	114 334	1 234	0,00
Bought SGD / Sold AUD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	2 795 554	3 090 000	11 728	0,00
Bought SGD / Sold CAD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	3 351 312	3 351 000	1 827	0,00
Bought SGD / Sold CLP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	125 499	82 328 000	872	0,00
Bought SGD / Sold CLP, due 05/02/24	BNP Paribas SA	126 333	82 328 000	1 823	0,00
Bought SGD / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	17 198 949	92 038 000	58 461	0,00
Bought SGD / Sold CNY, due 04/01/24	Citibank NA	504 429	2 694 000	2 474	0,00
Bought SGD / Sold CZK, due 04/01/24	UBS AG	508 091	8 451 000	7 081	0,00
Bought SGD / Sold CZK, due 05/02/24	UBS AG	499 346	8 451 000	1 389	0,00
Bought SGD / Sold DKK, due 04/01/24	UBS AG	427 865	2 180 000	1 319	0,00
Bought SGD / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	427 936	2 180 000	1 322	0,00
Bought SGD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 217 618	2 883 513	12 100	0,00
Bought SGD / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	23 527 504	16 085 000	67 885	0,00
Bought SGD / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	22 370 670	15 288 000	71 297	0,00
Bought SGD / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	23 065 807	15 770 500	68 737	0,00
Bought SGD / Sold EUR, due 05/02/24	Citibank NA	23 065 350	15 770 500	68 390	0,00
Bought SGD / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 083 000	1 235 594	4 038	0,00
Bought SGD / Sold GBP, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	479 147	284 000	1 209	0,00
Bought SGD / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	10 284 548	6 092 000	30 884	0,00
Bought SGD / Sold GBP, due 05/02/24	Citibank NA	10 726 198	6 376 000	13 982	0,00
Bought SGD / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	208 307	54 053 000	1 726	0,00
Bought SGD / Sold HUF, due 05/02/24	UBS AG	205 991	54 053 000	876	0,00
Bought SGD / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	1 536 656	17 927 409 000	845	0,00
Bought SGD / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 537 382	17 927 409 000	4 400	0,00
Bought SGD / Sold KRW, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	3 715 452	3 608 224 000	17 902	0,00
Bought SGD / Sold KRW, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	3 681 035	3 608 224 000	7 224	0,00
Bought SGD / Sold MXN, due 06/02/24	HSBC Bank PLC	1 241 974	16 038 000	1 057	0,00
Bought SGD / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	271 072	2 082 000	628	0,00
Bought SGD / Sold NZD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	378 448	453 000	473	0,00
Bought SGD / Sold PEN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	175 964	492 000	528	0,00
Bought SGD / Sold PEN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	175 683	492 000	628	0,00
Bought SGD / Sold PLN, due 04/01/24	UBS AG	678 468	2 016 000	1 688	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought SGD / Sold PLN, due 05/02/24	UBS AG	679 244	2 016 000	3 247	0,00
Bought SGD / Sold RON, due 04/01/24	BNP Paribas SA	284 055	967 000	633	0,00
Bought SGD / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	283 886	967 000	889	0,00
Bought SGD / Sold SEK, due 05/02/24	UBS AG	363 097	2 746 000	2 835	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 005 708	1 501 000	19 584	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	350 482	263 000	2 711	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 04/01/24	Citibank NA	20 326 423	15 285 668	124 364	0,01
	Goldman Sachs				
Bought SGD / Sold USD, due 04/01/24	International	20 327 557	15 285 666	125 227	0,01
Bought SGD / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	20 324 326	15 285 666	122 777	0,01
Bought SGD / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	659 000	498 658	948	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	20 946 493	15 873 666	29 382	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 05/02/24	Citibank NA	20 946 540	15 873 666	29 418	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	20 953 512	15 873 668	34 709	0,00
	Westpac Banking				
Bought THB / Sold EUR, due 04/01/24	Corporation	199 815 000	5 223 677	84 007	0,01
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought THB / Sold GBP, due 04/01/24	London	104 291 000	2 349 956	59 981	0,00
Bought THB / Sold GBP, due 04/01/24	Merrill Lynch International	10 148 000	228 606	5 907	0,00
	Westpac Banking				
Bought THB / Sold SGD, due 04/01/24	Corporation	29 338 000	1 118 350	11 748	0,00
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought THB / Sold USD, due 04/01/24	London	30 862 000	883 286	20 968	0,00
Bought USD / Sold AUD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	2 196 627	3 205 000	7 354	0,00
Bought USD / Sold CLP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	220 729	191 031 000	2 401	0,00
Bought USD / Sold CZK, due 04/01/24	UBS AG	512 540	11 339 000	5 208	0,00
Bought USD / Sold CZK, due 05/02/24	UBS AG	507 283	11 339 000	476	0,00
Bought USD / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	307 199	2 065 000	691	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	103 658 433	93 778 748	61 761	0,00
	Goldman Sachs				
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	International	121 495 192	109 977 898	3 442	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	103 658 436	93 766 112	75 725	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	17 610 884	15 911 250	11 862	0,00
	Goldman Sachs				
Bought USD / Sold EUR, due 05/02/24	International	17 500 602	15 807 250	16 611	0,00
Bought USD / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	246 710	85 142 000	675	0,00
Bought USD / Sold HUF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	245 519	85 142 000	555	0,00
Bought USD / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	236 302	2 395 000	280	0,00
Bought USD / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	575 206	2 255 000	2 004	0,00
Bought USD / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	242 456	1 090 000	510	0,00
Bought USD / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	231 371	2 310 000	1 855	0,00
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				11 804 416	0,59

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	136 000	79 342	(1 467)	(0,00)
Bought AUD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	19 842 000	12 266 404	(10 979)	(0,00)
Bought AUD / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	10 755 000	5 771 184	(18 233)	(0,00)
Bought AUD / Sold SGD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	3 090 000	2 797 080	(12 016)	(0,00)
Bought AUD / Sold USD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	3 205 000	2 194 500	(7 498)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CAD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	145 000	93 665	(1 319)	(0,00)
Bought CAD / Sold SGD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	3 351 000	3 354 934	(2 057)	(0,00)
Bought CHF / Sold COP, due 04/01/24	UBS AG	8 771	41 010 000	(163)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	552 466	92 845 000	(2 161)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	9 137	1 551 000	(146)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	Citibank NA	26 562	4 466 000	(118)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	UBS AG	534 991	89 971 001	(2 538)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	5 924	994 000	(23)	(0,00)
Bought CHF / Sold NOK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 186	51 000	(48)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought CHF / Sold SEK, due 04/01/24	London	3 000	36 000	(8)	(0,00)
Bought CLP / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	1 128 000	1 130	(51)	(0,00)
Bought CLP / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	726 183 000	766 428	(15 131)	(0,00)
Bought CLP / Sold GBP, due 04/01/24	Merrill Lynch International	43 623 000	39 661	(608)	(0,00)
Bought CLP / Sold GBP, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	169 818 000	154 371	(2 337)	(0,00)
Bought CLP / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	82 328 000	126 768	(1 835)	(0,00)
Bought CLP / Sold USD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	191 031 000	221 172	(2 427)	(0,00)
Bought CNH / Sold GBP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	1 133 000	125 702	(815)	(0,00)
Bought CNY / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	4 170 000	497 079	(2 571)	(0,00)
Bought CNY / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	503 000	56 133	(629)	(0,00)
Bought COP / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	41 010 000	9 002	(112)	(0,00)
Bought CZK / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	372 000	14 212	(241)	(0,00)
Bought CZK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	34 472 000	1 211 211	(1 708)	(0,00)
Bought CZK / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	8 451 000	500 665	(1 452)	(0,00)
Bought CZK / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	11 339 000	507 847	(516)	(0,00)
Bought DKK / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	94 000	11 899	(207)	(0,00)
Bought DKK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	14 363 000	1 926 809	(54)	(0,00)
Bought DKK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	6 621 000	770 882	(1 548)	(0,00)
Bought DKK / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 180 000	427 886	(1 335)	(0,00)
Bought DKK / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 065 000	306 703	(688)	(0,00)
Bought EUR / Sold AUD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	11 964 588	19 842 000	(322 435)	(0,02)
Bought EUR / Sold CAD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	14 486 655	21 609 000	(385 063)	(0,02)
Bought EUR / Sold CAD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	14 780 076	21 609 000	(47 924)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	694 000	654 436	(10 907)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	International	694 000	654 511	(10 996)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	London	519 537	490 000	(8 261)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	1 975 980	1 898 000	(72 244)	(0,01)
Bought EUR / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 536 035	2 388 000	(41 681)	(0,00)
Bought EUR / Sold CNY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	639 263	5 046 000	(6 725)	(0,00)
Bought EUR / Sold CNY, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	78 396 644	620 384 000	(1 045 856)	(0,05)
Bought EUR / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 252 560	5 640 429 000	(71 993)	(0,01)
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold COP, due 05/02/24	International	1 296 364	5 640 429 000	(12 381)	(0,00)
Bought EUR / Sold CZK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 581 339	63 923 000	(1 944)	(0,00)
Bought EUR / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 927 446	14 363 000	(1)	(0,00)
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	57 329 000	49 865 970	(238 549)	(0,01)
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	International	56 967 000	49 517 994	(194 849)	(0,01)

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold GBP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	407 000	354 028	(1 224)	(0,00)
Bought EUR / Sold GBP, due 05/02/24	BNP Paribas SA	48 031 065	41 757 920	(116 667)	(0,01)
Bought EUR / Sold HUF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	938 364	360 861 000	(338)	(0,00)
Bought EUR / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	7 260 919	123 879 858 000	(24 553)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 530 382	6 177 000	(24 821)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 540 222	6 177 000	(12 899)	(0,00)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 726 869	1 241 871 000	(273 030)	(0,02)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	Goldman Sachs International	85 420 943	13 782 958 000	(3 401 476)	(0,18)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	80 859 196	13 059 124 000	(3 306 499)	(0,17)
Bought EUR / Sold JPY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	90 622 163	14 220 838 000	(1 127 985)	(0,06)
Bought EUR / Sold JPY, due 05/02/24	Goldman Sachs International	89 167 333	13 992 138 000	(1 107 013)	(0,06)
Bought EUR / Sold KRW, due 05/02/24	JPMorgan Chase Bank NA London	17 108 608	24 466 850 000	(108 815)	(0,01)
Bought EUR / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 091 520	96 779 000	(89 452)	(0,01)
Bought EUR / Sold MXN, due 04/01/24	Standard Chartered Bank	543 298	10 273 000	(6 360)	(0,00)
Bought EUR / Sold MXN, due 06/02/24	UBS AG	5 665 824	107 052 000	(20 157)	(0,00)
Bought EUR / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	5 817 650	29 645 000	(25 275)	(0,00)
Bought EUR / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	5 803 982	29 645 000	(46 225)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	932 385	10 911 000	(44 402)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	971 185	10 911 000	(1 052)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 899 099	3 394 000	(50 991)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	1 941 085	3 394 000	(2 195)	(0,00)
Bought EUR / Sold PLN, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	3 022 729	13 136 000	(1 358)	(0,00)
Bought EUR / Sold RON, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 383 970	6 893 000	(1 692)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	1 184 275	13 454 000	(26 801)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	15 770 500	23 070 680	(68 979)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 04/01/24	Citibank NA	15 770 500	23 071 485	(69 589)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	2 715 904	3 973 000	(11 805)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 715 942	3 973 000	(12 358)	(0,00)
Bought EUR / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	5 214 352	199 815 000	(94 309)	(0,01)
Bought EUR / Sold THB, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	5 227 503	199 815 000	(89 077)	(0,01)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	96 025 980	106 292 433	(80 580)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Goldman Sachs International	93 628 482	103 658 433	(98 391)	(0,01)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	93 645 402	103 658 436	(79 680)	(0,01)
Bought GBP / Sold AUD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 459 317	10 447 000	(169 166)	(0,01)
Bought GBP / Sold AUD, due 04/01/24	Citibank NA	272 211	519 000	(7 135)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	562 173	961 000	(12 165)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 04/01/24	UBS AG	6 227 210	10 716 000	(188 574)	(0,01)
Bought GBP / Sold CAD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	50 916	87 000	(1 073)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	6 995 053	11 764 000	(7 011)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 038 299	1 151 000	(43 921)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	Goldman Sachs International	280 000	304 082	(4 347)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 042 681	1 130 000	(17 618)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought GBP / Sold CNH, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	9 206 685	83 454 000	(6 553)	(0,00)
Bought GBP / Sold CNY, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	27 994 815	253 759 000	(202 053)	(0,01)
Bought GBP / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	583 675	3 011 659 000	(33 178)	(0,00)
Bought GBP / Sold COP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	597 253	3 011 659 000	(10 701)	(0,00)
Bought GBP / Sold CZK, due 04/01/24	Merrill Lynch International	204 005	5 814 000	(64)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 457 286	2 843 000	(8 076)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	2 583 837	3 010 000	(31 233)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	43 878 975	50 639 500	(3 869)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	43 869 151	50 639 500	(16 393)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	3 025 036	3 505 000	(15 612)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	244 724	283 000	(988)	(0,00)
Bought GBP / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 383 586	66 616 049 000	(10 021)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	715 050	3 330 000	(13 226)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 04/01/24	Merrill Lynch International	154 704	727 000	(4 678)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 05/02/24	BNP Paribas SA	879 031	4 057 000	(6 591)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 053 255	378 769 000	(69 183)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 681 414	498 249 000	(115 900)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Citibank NA	2 209 402	408 576 000	(81 554)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	UBS AG	36 994 407	6 893 075 501	(1 733 285)	(0,09)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	39 540 756	7 362 551 500	(1 817 275)	(0,09)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	220 053	39 773 000	(2 919)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	42 960 609	7 745 883 501	(434 803)	(0,03)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	Merrill Lynch International	42 943 459	7 745 883 500	(456 667)	(0,03)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	214 429	38 513 000	(1 109)	(0,00)
Bought GBP / Sold KRW, due 04/01/24	UBS AG	612 678	1 012 083 000	(4 846)	(0,00)
Bought GBP / Sold KRW, due 05/02/24	UBS AG	7 765 444	12 855 622 000	(82 751)	(0,00)
Bought GBP / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 379 686	52 205 000	(48 641)	(0,00)
Bought GBP / Sold MXN, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	205 573	4 535 000	(5 689)	(0,00)
Bought GBP / Sold MXN, due 06/02/24	BNP Paribas SA	2 609 723	56 740 000	(4 883)	(0,00)
Bought GBP / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	2 521 346	14 912 000	(39 171)	(0,00)
Bought GBP / Sold NOK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	375 542	5 071 000	(20 595)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	785 092	1 619 000	(24 229)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	177 790	364 000	(3 818)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	932 601	1 879 000	(743)	(0,00)
Bought GBP / Sold PEN, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	172 634	818 000	(604)	(0,00)
Bought GBP / Sold PLN, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 497 448	7 509 000	(617)	(0,00)
Bought GBP / Sold RON, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	597 168	3 432 000	(782)	(0,00)
Bought GBP / Sold SEK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	543 760	7 128 000	(14 131)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 04/01/24	Citibank NA	6 376 000	10 740 665	(14 634)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	1 233 783	2 083 000	(6 347)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 237 160	2 083 000	(4 044)	(0,00)
Bought GBP / Sold THB, due 04/01/24	Merrill Lynch International	304 252	13 506 000	(7 862)	(0,00)
Bought GBP / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	2 295 515	100 933 000	(30 991)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought GBP / Sold THB, due 05/02/24	London	2 354 545	104 291 000	(62 227)	(0,00)
Bought HUF / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	2 429 000	6 001	(111)	(0,00)
Bought HUF / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	198 450 000	450 442	(764)	(0,00)
Bought HUF / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	54 053 000	207 151	(850)	(0,00)
Bought HUF / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	85 142 000	246 591	(555)	(0,00)
Bought IDR / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	832 653 000	46 460	(1 122)	(0,00)
Bought IDR / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	123 879 858 000	7 297 353	(15 694)	(0,00)
Bought IDR / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	17 927 409 000	1 540 043	(3 413)	(0,00)
Bought ILS / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	39 000	9 185	(82)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	94 416 501	564 931	(1 502)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	94 416 500	564 986	(1 569)	(0,00)
Bought JPY / Sold GBP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	55 478 000	310 315	(226)	(0,00)
Bought KRW / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	162 008 000	107 294	(1 679)	(0,00)
Bought MXN / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	669 000	33 648	(480)	(0,00)
Bought MXN / Sold SGD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	16 038 000	1 250 653	(1 241)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought MYR / Sold CHF, due 04/01/24	International	180 000	33 347	(445)	(0,00)
Bought NOK / Sold CHF, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	51 000	4 287	(71)	(0,00)
Bought NOK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 071 000	391 954	(326)	(0,00)
Bought NOK / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 082 000	271 263	(639)	(0,00)
Bought NOK / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 395 000	236 114	(280)	(0,00)
Bought NZD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	23 000	12 411	(184)	(0,00)
Bought NZD / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	453 000	378 974	(494)	(0,00)
Bought PEN / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	6 000	1 395	(37)	(0,00)
Bought PEN / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 573 000	631 234	(2 427)	(0,00)
Bought PEN / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	492 000	176 123	(649)	(0,00)
Bought PLN / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	81 000	17 619	(335)	(0,00)
Bought PLN / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	13 136 000	3 028 110	(4 585)	(0,00)
Bought PLN / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	6 931 000	1 386 952	(5 510)	(0,00)
Bought PLN / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	2 016 000	680 612	(3 313)	(0,00)
Bought PLN / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 255 000	575 445	(1 988)	(0,00)
Bought RON / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	43 000	8 158	(145)	(0,00)
Bought RON / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	6 893 000	1 385 659	(174)	(0,00)
Bought RON / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	3 432 000	598 679	(1 143)	(0,00)
Bought RON / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	967 000	284 446	(929)	(0,00)
Bought RON / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	1 090 000	242 559	(531)	(0,00)
Bought SEK / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	99 000	8 440	(204)	(0,00)
Bought SEK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	13 454 000	1 215 840	(8 070)	(0,00)
Bought SEK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 128 000	559 086	(5 404)	(0,00)
Bought SEK / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	2 746 000	363 199	(2 862)	(0,00)
Bought SEK / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 310 000	231 078	(1 853)	(0,00)
Bought SGD / Sold AUD, due 04/01/24	Citibank NA	2 847 064	3 228 000	(44 258)	(0,00)
Bought SGD / Sold CAD, due 04/01/24	Citibank NA	110 541	112 000	(1 137)	(0,00)
Bought SGD / Sold CAD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	3 175 133	3 239 000	(49 314)	(0,00)
Bought SGD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	507 163	333 000	(11 157)	(0,00)
Bought SGD / Sold CHF, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	28 000	18 061	(231)	(0,00)
Bought SGD / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	517 329	333 000	(4 200)	(0,00)
Bought SGD / Sold CNY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	17 524 389	94 732 000	(80 988)	(0,01)
Bought SGD / Sold COP, due 04/01/24	UBS AG	278 021	853 804 000	(9 575)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought SGD / Sold COP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	286 957	853 804 000	(1 059)	(0,00)
Bought SGD / Sold ILS, due 04/01/24	UBS AG	467 931	1 291 000	(3 774)	(0,00)
Bought SGD / Sold ILS, due 05/02/24	UBS AG	471 027	1 291 000	(1 136)	(0,00)
Bought SGD / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	19 002 756	2 098 348 000	(477 488)	(0,02)
Bought SGD / Sold JPY, due 04/01/24	Citibank NA	19 851 740	2 190 048 000	(484 297)	(0,02)
Bought SGD / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	19 967 275	2 144 198 000	(123 740)	(0,01)
Bought SGD / Sold JPY, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	19 974 791	2 144 198 000	(118 033)	(0,01)
Bought SGD / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 234 394	16 038 000	(11 085)	(0,00)
Bought SGD / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	1 172 542	4 091 000	(1 663)	(0,00)
Bought SGD / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	1 160 567	4 091 000	(12 727)	(0,00)
Bought SGD / Sold NOK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	260 248	2 082 000	(7 712)	(0,00)
Bought SGD / Sold NZD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	370 859	453 000	(5 659)	(0,00)
Bought SGD / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	353 610	2 746 000	(4 408)	(0,00)
Bought SGD / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	1 119 391	29 338 000	(10 959)	(0,00)
Bought SGD / Sold THB, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	1 119 149	29 338 000	(12 344)	(0,00)
Bought THB / Sold CHF, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	1 207 000	29 881	(138)	(0,00)
Bought USD / Sold AUD, due 04/01/24	Citibank NA	2 312 872	3 487 000	(66 559)	(0,00)
Bought USD / Sold CAD, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	2 593 340	3 517 000	(73 968)	(0,01)
Bought USD / Sold CAD, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	2 666 675	3 517 000	(1 842)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	699 334	596 184	(9 018)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	424 881	371 000	(15 920)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Goldman Sachs International	699 333	595 972	(8 766)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	699 333	596 531	(9 431)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	436 694	371 000	(5 573)	(0,00)
Bought USD / Sold CLP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	217 278	191 031 000	(1 467)	(0,00)
Bought USD / Sold CNY, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	257 272	1 836 000	(1 630)	(0,00)
Bought USD / Sold CNY, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	13 805 448	98 187 000	(40 338)	(0,00)
Bought USD / Sold CNY, due 05/02/24	Goldman Sachs International	13 378 126	95 458 000	(125 184)	(0,01)
Bought USD / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	399 028	1 647 662 000	(26 202)	(0,00)
Bought USD / Sold COP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	416 228	1 647 662 000	(6 248)	(0,00)
Bought USD / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	401 838	2 723 000	(1 688)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 118 000	1 034 722	(25 050)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	18 831 036	17 145 750	(109 743)	(0,01)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	58 004 999	45 646 625	(185 616)	(0,01)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Citibank NA	280 266	222 000	(2 741)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	57 445 999	45 152 009	(114 076)	(0,01)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	57 446 002	45 186 818	(158 448)	(0,01)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	8 268 751	6 513 100	(34 190)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	636 000	502 120	(4 217)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	8 226 851	6 469 100	(21 443)	(0,00)
Bought USD / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	1 256 900	19 635 626 000	(18 377)	(0,00)
Bought USD / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 266 259	19 635 626 000	(8 637)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,58) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold ILS, due 04/01/24	UBS AG	306 129	1 123 000	(5 741)	(0,00)
Bought USD / Sold ILS, due 05/02/24	UBS AG	310 478	1 123 000	(1 587)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	15 043 017	2 207 848 500	(617 705)	(0,03)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	15 037 207	2 207 848 500	(623 514)	(0,03)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	765 067	112 044 000	(29 684)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	100 080	14 147 000	(757)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	15 170 120	2 149 113 000	(148 256)	(0,01)
Bought USD / Sold JPY, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	15 151 991	2 149 113 000	(166 385)	(0,01)
Bought USD / Sold KRW, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	2 960 815	3 851 872 000	(30 200)	(0,00)
Bought USD / Sold KRW, due 05/02/24	JPMorgan Chase Bank NA London	2 953 980	3 851 872 000	(42 303)	(0,00)
Bought USD / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	979 434	16 924 000	(19 791)	(0,00)
Bought USD / Sold MXN, due 06/02/24	UBS AG	992 948	16 924 000	(1 009)	(0,00)
Bought USD / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	1 039 167	4 842 000	(14 654)	(0,00)
Bought USD / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	1 039 167	4 842 000	(16 920)	(0,00)
Bought USD / Sold NOK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	225 128	2 395 000	(10 707)	(0,00)
Bought USD / Sold NZD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	334 487	544 000	(9 947)	(0,00)
Bought USD / Sold NZD, due 05/02/24	UBS AG	344 079	544 000	(397)	(0,00)
Bought USD / Sold PEN, due 04/01/24	Standard Chartered Bank	268 174	1 006 000	(3 518)	(0,00)
Bought USD / Sold PEN, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	270 518	1 006 000	(927)	(0,00)
Bought USD / Sold PLN, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	570 766	2 255 000	(2 690)	(0,00)
Bought USD / Sold RON, due 04/01/24	BNP Paribas SA	240 745	1 090 000	(1 284)	(0,00)
Bought USD / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	223 657	2 310 000	(5 567)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	15 873 666	20 977 907	(30 275)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 04/01/24	Citibank NA	15 873 666	20 978 356	(30 615)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	495 481	659 000	(4 126)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	15 873 668	20 985 227	(35 823)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 05/02/24	UBS AG	499 383	659 000	(945)	(0,00)
Bought USD / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	879 262	30 862 000	(24 992)	(0,00)
Bought USD / Sold THB, due 05/02/24	JPMorgan Chase Bank NA London	885 122	30 862 000	(21 683)	(0,00)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(23 422 784)	(1,17)
Total des contrats de change à terme – couverture				(11 618 368)	(0,58)
Autres actifs/(passifs) nets				43 636 513	2,18
TOTAL DES ACTIFS NETS				2 004 170 610	100,00

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 %				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
Royaume-Uni				États-Unis (suite)			
45 984 GBP	Equity Release Funding No. 3 PLC Series 3, 5.050%, 26/04/33	58 931	0,00	22 785 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/12/29	22 212	0,00
Royaume-Uni – Total				104 533 USD			
58 931				0,00			
États-Unis				158 112 USD			
142 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/03/24	141	0,00	430 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.500%, 01/01/32	448	0,00
344 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/06/24	342	0,00	5 884 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/02/32	6 072	0,00
69 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/08/24	68	0,00	5 362 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.500%, 01/03/32	5 582	0,00
79 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/09/24	79	0,00	3 413 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.500%, 01/08/32	3 550	0,00
15 453 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/07/25	15 230	0,00	419 173 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/06/33	407 074	0,01
7 931 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/09/25	7 787	0,00	23 746 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/06/33	24 302	0,00
6 560 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/04/26	6 481	0,00	2 148 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/08/33	2 189	0,00
6 660 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/04/26	6 566	0,00	10 301 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/08/33	10 543	0,00
12 095 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/04/26	11 926	0,00	231 853 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/09/33	225 160	0,00
37 115 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/05/26	37 004	0,00	433 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/09/33	443	0,00
6 412 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/09/26	6 278	0,00	4 815 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/10/33	4 905	0,00
15 386 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/01/27	15 031	0,00	23 322 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/11/33	23 758	0,00
7 512 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/03/27	7 318	0,00	1 709 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/11/33	1 763	0,00
38 843 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/03/27	37 286	0,00	815 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/02/34	841	0,00
91 322 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/12/27	87 660	0,00	3 193 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/03/34	3 291	0,00
23 616 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 2.500%, 01/08/28	22 345	0,00	5 803 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/05/34	5 911	0,00
225 982 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 2.500%, 01/08/28	216 747	0,00	411 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/12/34	416	0,00
111 554 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 2.500%, 01/09/28	106 997	0,00	4 718 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/12/34	4 843	0,00
47 251 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/09/28	46 197	0,00	4 103 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/02/35	4 235	0,00
16 926 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/01/29	16 190	0,00	18 703 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.000%, 01/05/35	19 565	0,00
9 125 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/01/29	8 826	0,00	13 785 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/07/35	14 217	0,00
55 226 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/02/29	53 405	0,00	5 307 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/09/35	5 373	0,00
73 247 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/03/29	70 733	0,00	7 106 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/10/35	7 194	0,00
983 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/04/29	979	0,00	1 724 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/12/35	1 771	0,00
52 696 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/09/29	51 383	0,00	2 672 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.000%, 01/01/36	2 780	0,00
55 508 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 2.500%, 01/10/29	53 013	0,00	6 681 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/02/36	6 890	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
4 696 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/04/36	4 847	0,00	6 096 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/05/39	5 939	0,00
7 123 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/05/36	7 237	0,00	3 321 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/06/39	3 325	0,00
43 157 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/03/37	43 731	0,00	10 840 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/06/39	10 819	0,00
5 526 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/03/37	5 717	0,00	58 763 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/07/39	57 460	0,00
6 409 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/04/37	6 441	0,00	1 915 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.000%, 01/07/39	2 004	0,00
3 159 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/04/37	3 260	0,00	3 868 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/09/39	3 839	0,00
3 432 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/04/37	3 551	0,00	22 692 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/10/39	22 720	0,00
458 312 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/05/37	448 121	0,01	38 506 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/10/39	38 430	0,00
13 881 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/06/37	14 141	0,00	9 004 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/12/39	8 986	0,00
1 146 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/07/37	1 167	0,00	68 604 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/01/40	68 690	0,00
1 007 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/07/37	1 039	0,00	6 202 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/02/40	6 188	0,00
9 902 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 7.000%, 01/08/37	10 573	0,00	6 897 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/04/40	6 881	0,00
769 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/11/37	795	0,00	9 450 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.000%, 01/04/40	9 959	0,00
34 435 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.000%, 01/12/37	35 995	0,00	62 302 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/05/40	64 303	0,00
26 262 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/01/38	27 169	0,00	50 048 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.000%, 01/05/40	52 731	0,00
7 282 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/02/38	7 407	0,00	84 159 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/06/40	84 264	0,00
1 066 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/04/38	1 085	0,00	20 404 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/06/40	20 839	0,00
23 700 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/06/38	24 023	0,00	47 690 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/07/40	47 581	0,00
1 574 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/07/38	1 632	0,00	867 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/08/40	884	0,00
1 500 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/09/38	1 500	0,00	52 078 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/10/40	50 661	0,00
2 847 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/11/38	2 924	0,00	54 111 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/11/40	54 173	0,00
236 802 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.500%, 01/11/38	245 509	0,00	6 289 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/01/41	6 142	0,00
98 673 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/01/39	100 372	0,00	52 998 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/02/41	51 581	0,00
30 553 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/02/39	30 531	0,00	52 331 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/04/41	50 995	0,00
3 197 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/02/39	3 181	0,00	177 609 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/04/41	180 939	0,00
11 488 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/02/39	11 493	0,00	23 078 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/05/41	22 992	0,00
541 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/03/39	541	0,00	102 776 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/06/41	102 798	0,00
14 949 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/03/39	15 207	0,00	68 199 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.000%, 01/07/41	69 429	0,00
37 911 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/04/39	37 931	0,00	18 137 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/08/41	17 724	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
73 677 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/09/41	73 403	0,00	154 458 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/04/45	149 324	0,00
157 221 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/04/42	152 766	0,00	221 886 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/07/45	209 159	0,00
23 465 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/07/42	22 149	0,00	270 825 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/07/45	253 949	0,00
216 332 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/10/42	204 206	0,00	58 643 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/10/45	54 989	0,00
150 827 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/03/43	137 867	0,00	198 350 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/10/45	191 757	0,00
13 167 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/03/43	12 137	0,00	218 586 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/12/45	206 052	0,00
189 094 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/04/43	178 029	0,00	147 970 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/12/45	143 052	0,00
812 080 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/06/43	742 300	0,01	143 349 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/06/46	134 280	0,00
621 928 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/07/43	568 488	0,01	406 974 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/10/46	368 174	0,01
17 787 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/08/43	16 258	0,00	347 230 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/02/47	325 262	0,01
113 910 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/08/43	104 123	0,00	191 618 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/05/47	184 878	0,00
172 272 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/08/43	162 204	0,00	190 511 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/06/47	183 810	0,00
155 897 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/09/43	142 501	0,00	61 586 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/08/47	57 488	0,00
93 974 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/09/43	86 237	0,00	154 327 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/08/47	148 899	0,00
205 323 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/09/43	193 323	0,00	562 074 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/09/47	524 677	0,01
525 603 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.000%, 01/10/43	480 439	0,01	235 914 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/09/47	220 218	0,00
22 818 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/10/43	22 773	0,00	210 827 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/09/47	203 412	0,00
17 945 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/10/43	18 059	0,00	221 895 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/09/48	213 568	0,00
3 470 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/12/43	3 453	0,00	1 000 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K062, 3.413%, 25/12/26	972 080	0,02
5 952 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/12/43	5 952	0,00	5 869 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/01/25	5 787	0,00
69 998 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.500%, 01/03/44	69 600	0,00	29 378 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/04/26	28 858	0,00
47 187 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/05/44	45 686	0,00	44 341 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/12/26	43 273	0,00
180 029 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/05/44	174 289	0,00	6 498 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/12/26	6 364	0,00
83 310 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/06/44	78 150	0,00	46 737 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/01/27	45 883	0,00
97 607 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/08/44	91 561	0,00	1 937 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/05/27	1 870	0,00
137 346 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/11/44	128 839	0,00	13 459 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/10/27	13 050	0,00
162 597 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 4.000%, 01/12/44	157 425	0,00	3 316 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/10/27	3 216	0,00
109 091 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/01/45	102 334	0,00	34 368 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/12/27	33 304	0,00
169 522 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 3.500%, 01/02/45	159 022	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
3 417 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/12/27	3 311	0,00	78 774 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/04/34	80 529	0,00
54 311 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/05/28	51 566	0,00	6 698 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/08/34	6 979	0,00
239 425 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/07/28	229 368	0,00	7 699 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/03/35	7 654	0,00
106 235 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/08/28	101 844	0,00	5 790 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/04/35	5 794	0,00
153 224 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/08/28	146 887	0,00	3 369 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/04/35	3 402	0,00
106 555 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/08/28	102 155	0,00	172 104 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/05/35	161 728	0,00
54 144 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/09/28	51 826	0,00	6 812 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/05/35	6 810	0,00
3 247 USD	Federal National Mortgage Association, 6.500%, 01/10/28	3 357	0,00	19 019 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/07/35	19 172	0,00
72 722 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/11/28	70 320	0,00	11 016 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/08/35	11 206	0,00
123 349 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/06/29	118 937	0,00	8 459 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/10/35	8 513	0,00
40 499 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/08/29	38 994	0,00	16 117 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/10/35	16 611	0,00
118 218 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/08/29	113 882	0,00	3 652 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/10/35	3 762	0,00
113 478 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/09/29	109 220	0,00	5 936 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/12/35	6 115	0,00
121 938 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/10/29	118 514	0,00	14 361 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/12/35	15 038	0,00
97 647 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/02/30	93 085	0,00	75 313 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/01/36	77 580	0,00
194 423 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/04/30	186 652	0,00	6 031 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/01/36	6 264	0,00
154 858 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/09/30	148 479	0,00	37 203 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/02/36	37 620	0,00
174 162 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/02/31	164 784	0,00	36 000 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/04/36	37 084	0,00
59 530 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/02/31	58 424	0,00	19 482 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/04/36	20 167	0,00
101 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/04/31	104	0,00	8 054 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/05/36	8 193	0,00
188 133 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/10/31	184 241	0,00	13 995 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/08/36	14 471	0,00
238 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/01/32	246	0,00	1 593 USD	Federal National Mortgage Association, 6.500%, 01/08/36	1 693	0,00
547 561 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/02/32	524 312	0,01	3 358 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/09/36	3 509	0,00
2 329 445 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/02/32	2 239 663	0,03	7 221 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/11/36	7 302	0,00
84 583 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/08/32	80 484	0,00	11 821 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/11/36	12 024	0,00
397 USD	Federal National Mortgage Association, 7.000%, 01/03/33	410	0,00	2 762 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/12/36	2 861	0,00
8 315 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/09/33	8 458	0,00	27 455 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/01/37	28 582	0,00
1 383 526 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/12/33	1 309 716	0,02	380 123 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/02/37	364 274	0,01
33 086 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/03/34	33 370	0,00	92 993 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/02/37	97 669	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
5 127 400 USD	Federal National Mortgage Association, 1.500%, 01/03/37	4 470 909	0,07	45 828 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/07/39	46 564	0,00
1 495 926 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/03/37	1 344 572	0,02	16 179 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/08/39	16 129	0,00
15 945 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/03/37	16 545	0,00	87 452 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/09/39	85 160	0,00
4 044 683 USD	Federal National Mortgage Association, 1.500%, 01/04/37	3 526 819	0,05	19 973 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/09/39	19 970	0,00
12 741 USD	Federal National Mortgage Association, 7.000%, 01/05/37	13 243	0,00	1 004 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/12/39	981	0,00
527 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/07/37	542	0,00	35 913 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/01/40	36 073	0,00
1 607 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/08/37	1 631	0,00	137 976 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/04/40	145 272	0,00
140 149 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/09/37	132 156	0,00	20 983 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/05/40	21 682	0,00
913 968 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/12/37	897 025	0,01	25 428 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/06/40	25 341	0,00
1 881 628 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/02/38	1 773 415	0,03	1 292 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/08/40	1 262	0,00
12 233 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/02/38	12 734	0,00	12 997 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/09/40	12 691	0,00
456 593 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/03/38	437 330	0,01	21 880 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/09/40	21 877	0,00
95 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/04/38	96	0,00	57 799 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/10/40	56 414	0,00
1 479 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/05/38	1 470	0,00	1 136 571 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/11/40	1 132 693	0,02
62 984 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/05/38	66 290	0,00	270 221 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/12/40	262 573	0,00
616 258 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/06/38	590 259	0,01	70 277 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/01/41	68 288	0,00
13 468 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/06/38	13 435	0,00	56 740 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/02/41	55 134	0,00
21 232 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/07/38	21 884	0,00	239 311 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/03/41	232 271	0,00
25 433 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/11/38	25 397	0,00	10 843 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/04/41	10 790	0,00
26 544 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/11/38	27 488	0,00	110 757 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/05/41	110 379	0,00
81 123 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/12/38	84 804	0,00	25 516 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/07/41	24 175	0,00
77 806 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/01/39	77 721	0,00	25 541 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/09/41	24 842	0,00
7 565 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/02/39	7 361	0,00	399 215 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/01/42	397 275	0,01
6 282 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/02/39	6 273	0,00	65 800 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/02/42	62 328	0,00
2 423 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/03/39	2 452	0,00	224 720 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/03/42	218 572	0,00
37 598 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/04/39	37 482	0,00	20 171 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/04/42	19 646	0,00
34 514 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/05/39	33 701	0,00	213 665 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/06/42	217 359	0,00
31 906 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/05/39	31 900	0,00	160 797 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/09/42	151 611	0,00
16 105 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/06/39	16 383	0,00	60 948 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/09/42	57 461	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
198 831 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/10/42	187 456	0,00	161 269 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/10/44	151 104	0,00
364 185 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/01/43	331 784	0,01	57 727 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/10/44	55 827	0,00
177 676 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/01/43	167 526	0,00	19 078 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/12/44	18 957	0,00
45 046 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/05/43	41 466	0,00	93 251 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/01/45	87 374	0,00
129 011 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/05/43	117 788	0,00	182 990 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/01/45	171 457	0,00
194 005 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/06/43	177 130	0,00	180 215 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/05/45	168 787	0,00
428 694 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/07/43	391 404	0,01	173 334 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/07/45	167 390	0,00
163 909 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/07/43	149 651	0,00	237 839 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/08/45	223 697	0,00
328 750 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/07/43	309 191	0,01	231 806 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/08/45	217 106	0,00
55 834 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/07/43	52 610	0,00	217 393 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/09/45	196 811	0,00
55 203 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/08/43	50 401	0,00	147 188 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/09/45	142 140	0,00
488 599 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/08/43	446 098	0,01	134 532 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/09/45	129 955	0,00
139 334 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/08/43	127 214	0,00	194 957 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/09/45	188 271	0,00
107 712 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/08/43	98 343	0,00	58 556 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/11/45	53 012	0,00
256 917 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/08/43	234 569	0,00	301 627 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/11/45	273 070	0,01
51 239 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/09/43	46 959	0,00	133 727 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/11/45	125 247	0,00
371 634 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/09/43	348 418	0,01	464 458 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/12/45	435 004	0,01
127 097 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/09/43	119 225	0,00	1 040 533 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/12/45	1 013 437	0,02
21 054 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/09/43	19 674	0,00	219 081 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/02/46	204 977	0,00
20 646 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/09/43	19 418	0,00	1 064 684 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/03/46	1 028 170	0,02
11 274 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/09/43	10 613	0,00	132 060 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/04/46	123 558	0,00
82 593 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/09/43	82 336	0,00	371 576 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/04/46	359 809	0,01
34 174 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/10/43	31 202	0,00	114 662 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/05/46	107 281	0,00
70 815 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/10/43	66 602	0,00	365 883 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/08/46	330 608	0,01
150 686 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/10/43	145 914	0,00	111 401 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/08/46	107 390	0,00
16 791 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/12/43	17 006	0,00	395 525 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/09/46	357 392	0,01
244 354 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/01/44	229 816	0,00	252 624 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/10/46	228 269	0,00
58 051 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/07/44	56 141	0,00	73 373 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/11/46	66 299	0,00
127 284 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/09/44	123 095	0,00	283 812 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/12/46	256 450	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
165 426 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/12/46	159 472	0,00	722 098 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/07/48	711 832	0,01
107 869 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/01/47	97 469	0,00	530 797 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/08/48	510 327	0,01
564 668 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/01/47	510 229	0,01	740 354 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/11/48	670 258	0,01
315 538 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/01/47	285 117	0,01	556 753 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/01/49	548 846	0,01
1 758 832 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/01/47	1 589 264	0,02	256 119 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/03/49	245 862	0,00
1 783 359 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/02/47	1 611 427	0,03	477 882 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/05/49	443 558	0,01
2 572 700 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/02/47	2 442 936	0,04	503 730 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/07/49	483 557	0,01
157 217 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/02/47	151 825	0,00	1 036 534 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/08/49	962 085	0,02
98 564 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/03/47	92 221	0,00	573 135 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/08/49	576 734	0,01
377 828 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/04/47	352 297	0,01	954 561 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/10/49	960 570	0,02
81 509 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/04/47	78 553	0,00	1 017 671 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/11/49	911 567	0,01
241 212 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/04/47	238 180	0,00	2 269 530 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/12/49	2 041 548	0,03
258 323 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/05/47	241 693	0,00	1 976 575 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/01/50	1 770 494	0,03
629 624 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/05/47	626 667	0,01	8 364 144 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/09/50	6 957 061	0,11
201 240 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/06/47	187 641	0,00	8 753 636 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/10/51	7 162 885	0,11
264 657 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/07/47	255 059	0,00	1 749 511 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/01/52	1 731 836	0,03
326 512 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/08/47	314 671	0,01	7 503 362 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/02/52	6 136 324	0,09
337 054 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/09/47	304 287	0,01	1 954 183 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/02/52	1 727 367	0,03
215 897 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/09/47	201 308	0,00	7 050 543 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/03/52	5 757 680	0,09
38 983 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/09/47	37 569	0,00	1 048 569 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/05/52	976 607	0,02
203 437 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/09/47	200 881	0,00	2 314 022 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, 01/06/52	2 062 444	0,03
156 199 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/10/47	145 644	0,00	7 275 004 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/06/52	6 891 515	0,10
230 591 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/11/47	215 009	0,00	2 905 632 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/07/52	2 479 173	0,04
812 037 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/02/48	782 588	0,01	1 210 135 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/07/52	1 115 533	0,02
624 416 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/04/48	600 335	0,01	430 098 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/10/52	429 169	0,01
168 394 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/07/48	161 900	0,00	14 792 597 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/10/52	14 643 156	0,22
244 809 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/07/48	235 368	0,00	1 443 486 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/12/52	1 466 032	0,02
272 466 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/07/48	268 592	0,01	652 000 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/02/53	663 037	0,01
272 097 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/07/48	268 233	0,01	3 909 957 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, 01/03/53	3 795 415	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
9 492 536 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/05/53	9 536 920	0,14	5 061 790 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	4 323 895	0,07
4 675 939 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/05/53	4 748 771	0,07	7 351 888 USD	Federal National Mortgage Association, 1.500%, perpetual	5 728 435	0,09
6 293 704 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/06/53	6 229 733	0,09	6 197 758 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	5 299 482	0,08
876 365 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	826 774	0,01	10 588 998 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	8 674 217	0,13
649 381 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	611 505	0,01	3 268 926 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, perpetual	2 893 655	0,04
3 446 979 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	3 183 296	0,05	357 769 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, perpetual	329 053	0,01
1 469 119 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	1 320 551	0,02	5 379 564 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	4 398 209	0,07
9 228 940 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	8 280 214	0,13	2 224 887 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	1 898 340	0,03
1 665 924 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	1 536 020	0,02	2 764 056 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, perpetual	2 497 575	0,04
1 277 388 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	1 143 670	0,02	1 894 024 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, perpetual	1 686 518	0,03
442 899 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	396 131	0,01	13 293 017 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	11 392 666	0,17
4 267 488 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	3 661 163	0,06	6 138 377 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	5 226 921	0,08
1 057 338 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	1 022 542	0,02	8 318 648 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, perpetual	7 392 182	0,11
727 567 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, perpetual	686 002	0,01	3 683 984 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, perpetual	3 259 340	0,05
228 403 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	219 594	0,00	6 341 240 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, perpetual	5 837 785	0,09
1 033 454 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	995 976	0,02	5 515 053 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, perpetual	5 067 602	0,08
746 554 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	719 480	0,01	1 150 064 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	1 098 402	0,02
877 612 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, perpetual	814 578	0,01	1 389 314 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	1 326 800	0,02
3 270 253 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, perpetual	2 929 263	0,04	8 670 327 USD	Federal National Mortgage Association, 4.500%, perpetual	8 413 914	0,13
8 535 414 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	7 321 249	0,11	2 691 526 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	2 214 100	0,03
1 296 561 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, perpetual	1 158 747	0,02	696 272 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	626 119	0,01
3 854 385 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, perpetual	3 443 370	0,05	822 673 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	790 962	0,01
5 872 700 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	5 034 394	0,08	1 452 851 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	1 396 820	0,02
7 088 956 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	6 075 276	0,09	1 066 617 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	958 177	0,02
3 093 299 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	2 541 630	0,04	2 595 911 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, perpetual	2 420 492	0,04
3 466 273 USD	Federal National Mortgage Association, 3.000%, perpetual	3 121 007	0,05	1 053 425 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	1 024 946	0,02
6 566 284 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	5 624 085	0,09	3 006 517 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	2 457 870	0,04
6 985 144 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	5 769 438	0,09	563 251 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, perpetual	546 682	0,01
4 154 469 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	3 554 399	0,05	4 543 189 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	3 731 532	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
2 588 718 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	2 324 831	0,04	5 006 423 USD	Freddie Mac Pool, 5.000%, 01/02/53	4 955 846	0,08
6 788 226 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	5 565 696	0,08	616 522 USD	Freddie Mac Pool, 3.000%, perpetual	589 496	0,01
4 982 040 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	4 089 289	0,06	3 444 366 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, perpetual	3 108 442	0,05
17 867 464 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	14 641 295	0,22	1 669 163 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, perpetual	1 540 836	0,02
4 002 248 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, perpetual	3 440 965	0,05	3 320 085 USD	Freddie Mac Pool, 1.500%, perpetual	2 897 981	0,04
4 380 456 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, perpetual	3 745 144	0,06	2 767 705 USD	Freddie Mac Pool, 3.000%, perpetual	2 586 928	0,04
3 236 187 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, 01/02/36	2 909 505	0,04	1 001 512 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, perpetual	887 773	0,01
1 668 659 USD	Freddie Mac Pool, 1.500%, 01/01/37	1 456 512	0,02	762 338 USD	Freddie Mac Pool, 3.000%, perpetual	690 161	0,01
2 585 306 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, 01/03/37	2 314 675	0,04	1 081 000 USD	Freddie Mac Pool, 3.500%, perpetual	1 003 357	0,02
2 660 225 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, 01/03/37	2 390 496	0,04	1 539 478 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, perpetual	1 320 487	0,02
206 794 USD	Freddie Mac Pool, 3.000%, 01/07/37	193 824	0,00	1 754 635 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, perpetual	1 503 733	0,02
1 278 041 USD	Freddie Mac Pool, 3.500%, 01/09/37	1 230 456	0,02	4 297 954 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, perpetual	3 532 777	0,05
2 632 593 USD	Freddie Mac Pool, 3.500%, 01/06/47	2 465 648	0,04	3 089 374 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, perpetual	2 538 405	0,04
619 481 USD	Freddie Mac Pool, 3.500%, 01/07/49	574 987	0,01	2 251 691 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, perpetual	1 849 418	0,03
967 181 USD	Freddie Mac Pool, 3.000%, 01/10/49	866 341	0,01	3 525 952 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, perpetual	2 879 048	0,04
1 030 055 USD	Freddie Mac Pool, 3.000%, 01/01/50	922 660	0,01	5 875 894 USD	Freddie Mac Pool, 1.500%, perpetual	4 581 563	0,07
4 720 092 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, 01/09/50	3 910 765	0,06	7 377 869 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, perpetual	6 285 708	0,10
2 799 604 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, 01/12/51	2 318 488	0,04	1 411 601 USD	Freddie Mac Pool, 3.000%, perpetual	1 252 611	0,02
6 632 320 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, 01/02/52	5 420 890	0,08	4 914 307 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, perpetual	4 199 131	0,06
2 610 760 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, 01/02/52	2 160 357	0,03	4 323 969 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, perpetual	3 539 204	0,05
5 465 433 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, 01/03/52	4 469 017	0,07	4 105 265 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, perpetual	3 506 810	0,05
5 300 788 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, 01/04/52	4 565 236	0,07	1 833 840 USD	Freddie Mac Pool, 1.500%, perpetual	1 429 088	0,02
2 493 355 USD	Freddie Mac Pool, 4.000%, 01/09/52	2 360 375	0,04	7 456 515 USD	Freddie Mac Pool, 2.000%, perpetual	6 099 747	0,09
3 255 273 USD	Freddie Mac Pool, 4.500%, 01/12/52	3 177 559	0,05	5 016 095 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, perpetual	4 283 617	0,07
972 868 USD	Freddie Mac Pool, 5.000%, 01/12/52	974 408	0,02	4 380 971 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, perpetual	3 740 150	0,06
437 087 USD	Freddie Mac Pool, 5.000%, 01/12/52	433 052	0,01	3 792 568 USD	Freddie Mac Pool, 3.500%, perpetual	3 483 690	0,05
421 693 USD	Freddie Mac Pool, 5.500%, 01/12/52	429 563	0,01	805 790 USD	Freddie Mac Pool, 5.000%, perpetual	802 174	0,01
2 609 189 USD	Freddie Mac Pool, 4.000%, 01/01/53	2 469 221	0,04	1 300 000 USD	Ginnie Mae, 3.000%, 20/01/54	1 177 215	0,02
1 838 004 USD	Freddie Mac Pool, 5.500%, 01/01/53	1 847 954	0,03	1 000 000 USD	Ginnie Mae, 5.500%, 20/01/54	1 006 200	0,02
				1 200 000 USD	Ginnie Mae, 6.000%, 20/01/54	1 219 296	0,02

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
1 500 000 USD	Ginnie Mae, 6.500%, 20/01/54	1 535 250	0,02	22 389 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/06/38	22 750	0,00
1 400 000 USD	Ginnie Mae, 5.000%, perpetual	1 391 155	0,02	22 911 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/07/38	23 853	0,00
223 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/01/29	226	0,00	7 236 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/08/38	7 209	0,00
82 USD	Ginnie Mae I Pool, 7.000%, 15/07/31	86	0,00	34 161 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/11/38	35 497	0,00
14 189 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/02/32	14 560	0,00	14 297 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/12/38	14 463	0,00
3 488 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/04/32	3 601	0,00	28 813 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/01/39	28 782	0,00
185 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/10/32	189	0,00	40 052 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/01/39	40 685	0,00
9 222 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/10/32	9 492	0,00	5 059 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/01/39	5 118	0,00
3 146 USD	Ginnie Mae I Pool, 7.000%, 15/11/32	3 326	0,00	934 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/03/39	932	0,00
212 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/05/33	214	0,00	61 256 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/03/39	61 744	0,00
185 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/05/33	187	0,00	13 860 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/04/39	13 868	0,00
11 838 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/07/33	11 976	0,00	153 797 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/04/39	156 784	0,00
3 067 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/07/33	3 149	0,00	943 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/05/39	942	0,00
13 102 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/09/33	13 655	0,00	16 706 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/07/39	16 716	0,00
5 582 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/02/34	5 643	0,00	10 628 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/08/39	10 828	0,00
3 170 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/04/34	3 207	0,00	28 234 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/10/39	28 014	0,00
18 020 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/06/34	18 134	0,00	921 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/10/39	922	0,00
2 382 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/08/35	2 380	0,00	44 122 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/12/39	44 149	0,00
1 074 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/06/36	1 098	0,00	28 512 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/02/40	28 392	0,00
2 618 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/08/36	2 681	0,00	88 435 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/02/40	90 244	0,00
44 590 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/01/37	47 195	0,00	32 806 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/04/40	33 111	0,00
172 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/04/37	174	0,00	15 502 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/05/40	15 375	0,00
640 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/08/37	659	0,00	9 864 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/07/40	9 818	0,00
21 442 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/12/37	21 953	0,00	21 435 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/07/40	21 270	0,00
24 247 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/01/38	25 254	0,00	61 961 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/07/40	61 612	0,00
10 596 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/02/38	11 026	0,00	26 920 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/07/40	26 932	0,00
8 144 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/03/38	8 114	0,00	34 259 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/07/40	34 085	0,00
36 440 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.500%, 15/04/38	36 861	0,00	23 229 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.000%, 15/08/40	22 652	0,00
40 785 USD	Ginnie Mae I Pool, 5.000%, 15/06/38	41 942	0,00	16 346 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.000%, 15/01/41	15 976	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
40 590 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/01/41	40 353	0,00	121 967 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/03/43	115 862	0,00
83 246 USD	Ginnie Mae I Pool, 6.000%, 15/03/41	88 485	0,00	288 649 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/05/43	274 200	0,01
52 769 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/06/41	52 769	0,00	319 654 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/05/43	313 114	0,01
22 164 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/07/41	22 011	0,00	287 974 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/06/43	265 720	0,01
14 992 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/07/41	14 889	0,00	259 962 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/06/43	246 949	0,00
65 236 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/07/41	64 930	0,00	22 953 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.000%, 20/07/43	23 360	0,00
30 692 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.500%, 15/10/41	30 540	0,00	36 755 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/08/43	35 856	0,00
121 220 USD	Ginnie Mae I Pool, 3.500%, 15/02/42	115 126	0,00	163 259 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/09/43	155 087	0,00
297 942 USD	Ginnie Mae I Pool, 3.000%, 15/05/42	274 391	0,01	22 739 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/10/43	22 637	0,00
34 014 USD	Ginnie Mae I Pool, 3.500%, 15/06/42	32 304	0,00	44 845 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/11/43	44 644	0,00
20 019 USD	Ginnie Mae I Pool, 3.500%, 15/07/42	19 012	0,00	45 339 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/01/44	45 136	0,00
30 014 USD	Ginnie Mae I Pool, 3.500%, 15/04/43	28 499	0,00	79 538 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/02/44	77 591	0,00
112 967 USD	Ginnie Mae I Pool, 3.000%, 15/07/43	103 235	0,00	17 134 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/03/44	16 703	0,00
159 445 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.000%, 15/07/44	155 452	0,00	36 067 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/05/44	35 160	0,00
86 702 USD	Ginnie Mae I Pool, 4.000%, 15/05/45	84 128	0,00	37 888 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/06/44	36 967	0,00
192 329 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/01/41	187 859	0,00	58 924 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.000%, 20/06/44	59 956	0,00
34 115 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/04/41	34 089	0,00	145 857 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/08/44	142 190	0,00
24 628 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.000%, 20/06/41	25 111	0,00	179 617 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/10/44	170 453	0,00
53 262 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/11/41	52 020	0,00	24 496 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/10/44	23 880	0,00
66 073 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/04/42	64 513	0,00	51 657 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/11/44	51 347	0,00
949 482 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/05/42	902 006	0,01	53 320 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/12/44	49 213	0,00
26 320 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/07/42	25 699	0,00	111 281 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/12/44	105 603	0,00
71 176 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/08/42	65 665	0,00	147 481 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/12/44	143 773	0,00
66 127 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/10/42	62 820	0,00	39 004 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/12/44	38 770	0,00
74 039 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/12/42	68 306	0,00	53 920 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/02/45	52 565	0,00
326 262 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/01/43	300 999	0,01	105 192 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/03/45	99 413	0,00
62 751 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/02/43	59 614	0,00	248 783 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/04/45	228 835	0,00
91 891 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/03/43	84 789	0,00	282 314 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/04/45	266 794	0,01
333 123 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/03/43	307 373	0,01	161 533 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/06/45	148 581	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
222 140 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/06/45	209 938	0,00	244 963 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/12/47	242 187	0,00
288 232 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/07/45	265 121	0,00	337 957 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/01/48	318 723	0,01
176 348 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/10/45	166 661	0,00	591 150 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/09/48	570 745	0,01
126 462 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/10/45	123 059	0,00	577 258 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/10/48	557 332	0,01
154 085 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/03/46	145 621	0,00	693 413 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/12/48	685 695	0,01
1 655 136 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/03/46	1 610 595	0,03	617 237 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/08/49	580 347	0,01
271 857 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/04/46	256 595	0,00	373 565 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/09/49	351 152	0,01
1 879 250 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/06/46	1 773 746	0,03	387 821 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/10/49	364 552	0,01
200 551 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/10/46	184 409	0,00	324 332 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/11/49	304 835	0,01
678 281 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/10/46	640 201	0,01	1 019 095 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/12/49	928 961	0,01
407 728 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/11/46	374 299	0,01	1 232 733 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/02/50	1 123 019	0,02
2 894 301 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, 20/12/46	2 569 226	0,04	5 688 496 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, 20/01/51	4 825 495	0,07
186 217 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/12/46	171 229	0,00	1 220 921 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, 20/01/51	1 073 433	0,02
142 219 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/01/47	130 772	0,00	1 956 821 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, 20/07/51	1 716 312	0,03
328 765 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/01/47	310 307	0,01	2 845 382 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/08/51	2 582 196	0,04
300 902 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/02/47	276 683	0,01	4 204 311 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, 20/09/51	3 681 366	0,06
343 364 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/02/47	341 282	0,01	5 355 336 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, 20/01/52	4 530 270	0,07
243 708 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/03/47	229 838	0,00	956 787 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, 20/03/52	809 202	0,01
146 356 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/03/47	141 731	0,00	2 357 621 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/03/52	2 133 196	0,03
167 914 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/04/47	162 291	0,00	3 437 025 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, 20/05/52	3 008 383	0,05
208 862 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/05/47	196 975	0,00	1 928 430 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, 20/06/52	1 689 701	0,03
61 170 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/06/47	59 121	0,00	721 208 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/09/52	687 972	0,01
234 887 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/07/47	221 519	0,00	1 733 359 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/10/52	1 612 668	0,03
1 131 710 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/08/47	1 039 337	0,02	1 370 930 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/10/52	1 338 616	0,02
304 305 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/08/47	286 986	0,01	3 095 503 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/11/52	2 952 850	0,05
289 803 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/09/47	266 148	0,01	1 418 035 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.000%, 20/11/52	1 408 995	0,02
75 455 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/09/47	71 161	0,00	1 622 375 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, 20/12/52	1 509 412	0,02
132 656 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/09/47	128 214	0,00	1 393 567 USD	Ginnie Mae II Pool, 6.000%, 20/12/52	1 418 087	0,02
176 286 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/10/47	161 897	0,00	4 251 551 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, 20/03/53	4 151 336	0,06

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)				Obligations adossées à des actifs – 9,59 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
2 961 434 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.000%, 20/05/53	2 940 863	0,05	2 850 000 USD	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA, 5.000%, 01/01/54	2 822 586	0,04
4 434 475 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.500%, 20/05/53	4 460 110	0,07	2 000 000 USD	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA, 7.000%, 01/01/54	2 061 900	0,03
3 577 618 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, perpetual	3 381 094	0,05	500 000 USD	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust Series 2015-C31, 3.695%, 15/11/48	481 810	0,01
2 425 060 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, perpetual	2 210 576	0,03	États-Unis – Total			640 124 540
2 341 095 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, perpetual	2 134 372	0,03	Total des obligations adossées à des actifs			640 183 471
3 921 290 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, perpetual	3 451 838	0,05	Titres adossés à des hypothèques – 1,79 %			
2 262 809 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, perpetual	1 990 929	0,03	États-Unis			
1 353 617 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, perpetual	1 148 930	0,02	350 000 USD	Bank Series 2017-BNK7, 3.175%, 15/09/60	326 229	0,01
858 058 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, perpetual	781 495	0,01	100 000 USD	Bank Series 2018-BN13, 4.217%, 15/08/61	95 710	0,00
3 711 108 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, perpetual	3 144 528	0,05	191 107 USD	Bank Series 2018-BN14, 4.231%, 15/09/60	184 446	0,00
2 107 889 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, perpetual	1 785 748	0,03	200 000 USD	Benchmark Mortgage Trust Series 2018-B4, 4.121%, 15/07/51	191 347	0,00
3 633 127 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, perpetual	3 077 328	0,05	200 000 USD	Benchmark Mortgage Trust Series 2018-B5, 4.208%, 15/07/51	191 707	0,00
3 811 280 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, perpetual	3 339 011	0,05	200 000 USD	CD Mortgage Trust Series 2017-CD6, 3.456%, 13/11/50	187 742	0,00
4 522 635 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, perpetual	3 828 658	0,06	319 125 USD	COMM Mortgage Trust Series 2015-CR26, 3.359%, 10/10/48	307 933	0,01
4 378 153 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, perpetual	3 832 869	0,06	484 727 USD	COMM Mortgage Trust Series 2015-CR27, 3.349%, 10/10/48	467 982	0,01
3 022 989 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, perpetual	2 557 722	0,04	66 678 USD	CSAIL Commercial Mortgage Trust Series 2017-C8, 3.392%, 15/06/50	61 168	0,00
3 929 220 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, perpetual	3 560 924	0,05	400 000 USD	CSAIL Commercial Mortgage Trust Series 2018-CX12, 4.224%, 15/08/51	383 817	0,01
4 329 321 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, perpetual	3 789 925	0,06	2 499 460 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp Multifamily Structured Pass-Through Certificates, 5.000%, 25/11/28	2 568 462	0,04
2 659 471 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, perpetual	2 249 247	0,03	5 245 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K067, 3.194%, 25/07/27	5 042 795	0,08
2 299 252 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, perpetual	2 080 383	0,03	365 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K070, 3.303%, 25/11/27	351 391	0,01
2 237 719 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, perpetual	1 892 550	0,03	138 537 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K094, 2.903%, 25/06/29	129 032	0,00
4 868 072 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.500%, perpetual	4 529 117	0,07	1 000 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K100, 2.673%, 25/09/29	915 214	0,01
2 846 834 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, perpetual	2 715 641	0,04				
3 355 967 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.500%, perpetual	3 276 862	0,05				
1 000 000 USD	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2016-C30, 2.860%, 15/09/49	930 756	0,01				
200 000 USD	SG Commercial Mortgage Securities Trust Series 2016-C5, 3.055%, 10/10/48	186 337	0,00				
800 000 USD	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA, 5.000%, 01/01/39	804 944	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Titres adossés à des hypothèques – 1,79 % (suite)				Titres adossés à des hypothèques – 1,79 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
500 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K102, 2.537%, 25/10/29	454 046	0,01	1 100 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K753, 4.400%, 25/10/30	1 099 441	0,02
1 000 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K113, 1.341%, perpetual	833 094	0,01	2 370 967 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K754, 4.940%, 25/11/30	2 444 142	0,04
500 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K115, 1.383%, perpetual	416 605	0,01	949 189 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/02/36	875 174	0,01
1 500 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K117, 1.406%, perpetual	1 246 825	0,02	1 154 626 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/11/36	1 036 244	0,02
1 912 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K119, 1.566%, 25/09/30	1 602 203	0,02	589 616 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/02/50	551 556	0,01
2 000 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K136, 2.127%, perpetual	1 700 482	0,03	1 967 042 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/04/51	1 615 623	0,02
880 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K137, 2.347%, perpetual	760 150	0,01	7 598 654 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/07/51	6 250 557	0,09
250 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K140, 2.250%, perpetual	213 830	0,00	2 555 386 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/09/51	2 092 041	0,03
300 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K-1511, 3.542%, 25/03/34	278 230	0,00	2 983 823 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/11/51	2 451 678	0,04
3 175 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K-1513, 2.726%, 25/12/31	2 850 275	0,04	2 176 921 USD	Federal National Mortgage Association, 2.500%, 01/12/51	1 878 388	0,03
250 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K-154, 4.350%, 25/01/33	248 556	0,00	973 564 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/01/52	903 638	0,01
400 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K734, 3.208%, 25/02/26	389 234	0,01	4 631 280 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/01/52	4 656 352	0,07
195 922 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K735, 2.862%, 25/05/26	188 690	0,00	1 981 208 USD	Federal National Mortgage Association, 2.000%, 01/02/52	1 626 707	0,03
733 333 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K747, 2.050%, perpetual	660 738	0,01	2 455 723 USD	Federal National Mortgage Association, 3.500%, 01/05/52	2 256 864	0,03
1 000 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Pass-Through Certificates Series K748, 2.260%, perpetual	907 521	0,01	749 906 USD	Federal National Mortgage Association, 4.000%, 01/10/52	709 911	0,01
				1 442 611 USD	Federal National Mortgage Association, 6.500%, 01/06/53	1 477 464	0,02
				338 766 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/07/53	343 693	0,01
				1 122 431 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/07/53	1 148 621	0,02
				2 926 778 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/08/53	2 940 463	0,04
				2 448 200 USD	Federal National Mortgage Association, 6.000%, 01/08/53	2 486 333	0,04
				1 135 009 USD	Federal National Mortgage Association, 5.000%, 01/10/53	1 123 473	0,02
				809 441 USD	Federal National Mortgage Association, 5.500%, 01/10/53	813 226	0,01
				100 000 USD	Federal National Mortgage Association-Aces Series 2018-M12, 1.000%, 25/08/30	95 828	0,00
				116 122 USD	Federal National Mortgage Association-Aces Series 2018-M13, 1.000%, 25/09/30	111 757	0,00

Tableau des investissements (suite)
au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Titres adossés à des hypothèques – 1,79 % (suite)				Titres adossés à des hypothèques – 1,79 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
237 976 USD	Federal National Mortgage Association-Aces Series 2018-M2, 1.000%, 25/01/28	226 336	0,00	1 498 489 USD	Ginnie Mae II Pool, 6.000%, 20/09/53	1 522 276	0,02
337 296 USD	Federal National Mortgage Association-Aces Series 2019-M9, 2.937%, 25/06/29	317 096	0,01	1 374 889 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.500%, 20/10/53	1 382 837	0,02
2 500 000 USD	Federal National Mortgage Association-Aces Series 2021-M3G, 1.000%, perpetual	2 034 136	0,03	186 000 USD	GS Mortgage Securities Trust Series 2014-GC18, 1.000%, 10/01/47	163 024	0,00
1 000 000 USD	Federal National Mortgage Association-Aces Series 2022-M1, 1.000%, perpetual	821 685	0,01	32 461 USD	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2016-JP2, 2.713%, 15/08/49	31 371	0,00
568 961 USD	Freddie Mac Pool, 4.500%, 01/05/38	565 784	0,01	109 085 USD	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust Series 2017-JP5, 3.549%, 15/03/50	105 630	0,00
1 483 202 USD	Freddie Mac Pool, 3.500%, 01/03/52	1 360 602	0,02	300 000 USD	Morgan Stanley Capital I Series 2017-HR2, 3.587%, 15/12/50	283 462	0,01
6 547 963 USD	Freddie Mac Pool, 2.500%, 01/04/52	5 601 627	0,08	125 000 USD	UBS Commercial Mortgage Trust Series 2017-C5, 4.100%, 15/11/50	108 820	0,00
1 949 400 USD	Freddie Mac Pool, 3.000%, 01/04/52	1 743 403	0,03	300 000 USD	UBS Commercial Mortgage Trust Series 2018-C13, 4.334%, 15/10/51	286 435	0,01
987 039 USD	Freddie Mac Pool, 4.500%, 01/06/52	957 824	0,02	668 797 USD	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust Series 2015-C28, 3.290%, 15/05/48	648 607	0,01
3 647 758 USD	Freddie Mac Pool, 3.000%, 01/07/52	3 226 724	0,05	750 000 USD	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust Series 2017-C41, 3.472%, 15/11/50	706 863	0,01
1 966 615 USD	Freddie Mac Pool, 4.000%, 01/07/52	1 862 338	0,03	États-Unis – Total			
745 146 USD	Freddie Mac Pool, 4.000%, 01/10/52	704 815	0,01	119 402 472 1,79			
2 274 289 USD	Freddie Mac Pool, 4.500%, 01/01/53	2 207 030	0,03	Total des titres adossés à des hypothèques			
4 618 750 USD	Freddie Mac Pool, 6.000%, 01/03/53	4 690 692	0,07	119 402 472 1,79			
1 437 559 USD	Freddie Mac Pool, 6.000%, 01/07/53	1 459 950	0,02	Obligations d'entreprise – 23,11 %			
2 855 182 USD	Freddie Mac Pool, 6.500%, 01/10/53	2 924 430	0,04	Australie			
3 615 730 USD	Freddie Mac Pool, 6.500%, 01/11/53	3 761 052	0,06	500 000 AUD	AGI Finance Pty Ltd, 1.815%, 23/11/28	291 810	0,00
961 672 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.000%, 20/12/50	816 015	0,01	100 000 EUR	APA Infrastructure Ltd, 2.000%, 22/03/27	105 521	0,00
2 895 167 USD	Ginnie Mae II Pool, 2.500%, 20/12/50	2 546 055	0,04	100 000 EUR	APA Infrastructure Ltd, 0.750%, 15/03/29	96 124	0,00
1 729 227 USD	Ginnie Mae II Pool, 3.000%, 20/08/52	1 568 233	0,02	100 000 GBP	APA Infrastructure Ltd, 3.500%, 22/03/30	116 375	0,00
1 478 719 USD	Ginnie Mae II Pool, 4.000%, 20/04/53	1 410 574	0,02	100 000 EUR	APA Infrastructure Ltd, 2.000%, 15/07/30	99 514	0,00
3 786 957 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.000%, 20/07/53	3 760 653	0,06	100 000 EUR	APA Infrastructure Ltd, 1.250%, 15/03/33	89 135	0,00
889 459 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.500%, 20/07/53	894 601	0,01	500 000 AUD	Ausgrid Finance Pty Ltd, 1.814%, 05/02/27	309 452	0,01
1 387 087 USD	Ginnie Mae II Pool, 6.500%, 20/07/53	1 419 723	0,02	100 000 EUR	Ausnet Services Holdings Pty Ltd, 1.500%, 26/02/27	103 925	0,00
619 419 USD	Ginnie Mae II Pool, 5.500%, 20/08/53	623 000	0,01	300 000 EUR	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1.625%, 11/03/81	299 233	0,01
1 490 481 USD	Ginnie Mae II Pool, 6.000%, 20/08/53	1 514 141	0,02	700 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 3.437%, 04/04/25	774 191	0,01
				100 000 USD	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 3.700%, 16/11/25	98 119	0,00
				200 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 3.652%, 20/01/26	222 574	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Australie (suite)				Australie (suite)			
100 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0.750%, 29/09/26	103 686	0,00	500 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 0.625%, 16/03/27	513 839	0,01
500 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0.669%, 05/05/31	506 073	0,01	1 000 000 USD	National Australia Bank Ltd, 4.944%, 12/01/28	1 011 300	0,02
100 000 EUR	BHP Billiton Finance Ltd, 1.500%, 29/04/30	98 953	0,00	100 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 2.125%, 24/05/28	106 668	0,00
100 000 GBP	BHP Billiton Finance Ltd, 4.300%, 25/09/42	117 473	0,00	100 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 1.375%, 30/08/28	102 132	0,00
100 000 USD	BHP Billiton Finance USA Ltd, 5.000%, 30/09/43	101 254	0,00	1 000 000 USD	National Australia Bank Ltd, 5.134%, 28/11/28	1 026 540	0,02
300 000 USD	Commonwealth Bank of Australia, 2.296%, 14/03/25	291 114	0,00	100 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 1.125%, 20/05/31	98 970	0,00
500 000 USD	Commonwealth Bank of Australia, 5.316%, 13/03/26	506 975	0,01	1 000 000 USD	National Australia Bank Ltd, 6.429%, 12/01/33	1 056 920	0,02
300 000 USD	Commonwealth Bank of Australia, 1.125%, 15/06/26	275 481	0,00	500 000 USD	National Australia Bank Ltd, 2.648%, 14/01/41	326 000	0,01
100 000 GBP	Commonwealth Bank of Australia, 3.000%, 04/09/26	123 112	0,00	300 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 0.010%, perpetual	286 315	0,00
500 000 EUR	Commonwealth Bank of Australia, 0.750%, 28/02/28	506 383	0,01	500 000 USD	NBN Co Ltd, 2.625%, 05/05/31	430 160	0,01
100 000 EUR	Commonwealth Bank of Australia, 0.125%, 15/10/29	94 132	0,00	300 000 USD	QBE Insurance Group Ltd, 5.250%, perpetual	286 944	0,00
100 000 EUR	Commonwealth Bank of Australia, 1.625%, 10/02/31	100 676	0,00	50 000 USD	Rio Tinto Finance USA Ltd, 5.200%, 02/11/40	51 701	0,00
500 000 USD	Commonwealth Bank of Australia, 3.743%, 12/09/39	391 720	0,01	100 000 USD	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2, 3.500%, 12/02/25	97 878	0,00
300 000 USD	Commonwealth Bank of Australia, 3.900%, 12/07/47	257 754	0,00	300 000 EUR	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2, 1.450%, 28/03/29	291 956	0,01
100 000 EUR	Goodman Australia Finance Pty Ltd, 1.375%, 27/09/25	106 769	0,00	100 000 EUR	Stockland Trust, 1.625%, 27/04/26	104 901	0,00
500 000 AUD	Macquarie Bank Ltd, 1.700%, 12/02/25	330 059	0,01	100 000 EUR	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd, 1.750%, 26/04/28	103 923	0,00
300 000 USD	Macquarie Bank Ltd, 3.231%, 21/03/25	293 451	0,01	300 000 EUR	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd, 4.375%, 03/05/33	348 584	0,01
200 000 USD	Macquarie Bank Ltd, 4.875%, 10/06/25	197 360	0,00	100 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.375%, 26/03/29	102 060	0,00
1 000 000 USD	Macquarie Bank Ltd, 6.798%, 18/01/33	1 061 700	0,02	100 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.000%, 23/04/30	98 403	0,00
500 000 USD	Macquarie Group Ltd, 1.340%, 12/01/27	459 380	0,01	100 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 2.000%, 28/08/25	107 928	0,00
100 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.625%, 03/02/27	101 388	0,00	300 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 3.000%, 08/04/30	324 237	0,01
100 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.943%, 19/01/29	97 046	0,00	100 000 EUR	Vicinity Centres Trust, 1.125%, 07/11/29	93 642	0,00
100 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.950%, 21/05/31	91 622	0,00	200 000 EUR	Westpac Banking Corp, 0.500%, 16/01/25	214 320	0,00
300 000 USD	Macquarie Group Ltd, 2.871%, 14/01/33	246 900	0,00	100 000 GBP	Westpac Banking Corp, 2.125%, 02/05/25	122 627	0,00
500 000 AUD	National Australia Bank Ltd, 1.650%, 21/01/25	331 056	0,01	100 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.700%, 19/08/26	95 557	0,00
700 000 AUD	National Australia Bank Ltd, 3.900%, 30/05/25	473 494	0,01	500 000 EUR	Westpac Banking Corp, 1.079%, 05/04/27	520 517	0,01
500 000 USD	National Australia Bank Ltd, 3.500%, 09/06/25	491 090	0,01	100 000 EUR	Westpac Banking Corp, 1.450%, 17/07/28	103 001	0,00
1 000 000 USD	National Australia Bank Ltd, 4.966%, 12/01/26	1 006 340	0,02	100 000 EUR	Westpac Banking Corp, 0.010%, 22/09/28	95 963	0,00
100 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 0.875%, 19/02/27	103 707	0,00	500 000 USD	Westpac Banking Corp, 5.535%, 17/11/28	519 730	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Australie (suite)				Autriche (suite)			
300 000 USD	Westpac Banking Corp, 1.953%, 20/11/28	266 052	0,00	100 000 EUR	HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG, 0.125%, 30/06/26	100 941	0,00
100 000 EUR	Westpac Banking Corp, 0.766%, 13/05/31	101 257	0,00	300 000 EUR	Hypo Vorarlberg Bank AG, 0.625%, 17/07/26	312 542	0,01
100 000 EUR	Westpac Banking Corp, 1.375%, 17/05/32	96 844	0,00	100 000 EUR	KAF Kaerntner Ausgleichszahlungs-Fonds, zero coupon, 14/01/32	87 755	0,00
30 000 USD	Westpac Banking Corp, 4.110%, 24/07/34	27 480	0,00	300 000 EUR	Mondi Finance Europe GmbH, 2.375%, 01/04/28	324 714	0,01
40 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.668%, 15/11/35	32 557	0,00	150 000 EUR	OeBB-Infrastruktur AG, 3.375%, 18/05/32	174 864	0,00
275 000 USD	Westpac Banking Corp, 4.421%, 24/07/39	240 289	0,00	1 000 000 USD	Oesterreichische Kontrollbank AG, 2.875%, 23/05/25	975 850	0,01
30 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.963%, 16/11/40	20 713	0,00	590 000 USD	Oesterreichische Kontrollbank AG, 0.375%, 17/09/25	550 458	0,01
500 000 USD	Westpac Banking Corp, 3.133%, 18/11/41	349 130	0,01	500 000 USD	Oesterreichische Kontrollbank AG, 4.625%, 03/11/25	501 170	0,01
600 000 EUR	Westpac Banking Corp, 3.799%, perpetual	683 071	0,01	1 000 000 USD	Oesterreichische Kontrollbank AG, 4.125%, 20/01/26	995 520	0,02
100 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.150%, perpetual	84 546	0,00	500 000 EUR	Oesterreichische Kontrollbank AG, 1.500%, 13/07/27	534 330	0,01
400 000 AUD	Woolworths Group Ltd, 1.850%, 20/05/25	262 898	0,00	500 000 USD	Oesterreichische Kontrollbank AG, 4.250%, 01/03/28	503 585	0,01
Australie – Total		22 279 674	0,33	100 000 EUR	OMV AG, 0.010%, 03/07/25	105 193	0,00
Autriche				100 000 EUR	OMV AG, 2.000%, 09/04/28	107 090	0,00
500 000 EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 1.750%, 08/03/30	518 860	0,01	100 000 EUR	OMV AG, 1.875%, 04/12/28	105 172	0,00
400 000 EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 0.100%, 12/05/31	360 849	0,01	160 000 EUR	OMV AG, 0.750%, 16/06/30	153 626	0,00
200 000 EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 0.625%, 19/06/34	173 587	0,00	100 000 EUR	OMV AG, 2.375%, 09/04/32	105 645	0,00
100 000 EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 0.375%, 25/03/41	69 981	0,00	500 000 EUR	OMV AG, 2.500%, perpetual	520 108	0,01
300 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.050%, 16/09/25	313 235	0,01	100 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.250%, 22/01/25	106 226	0,00
100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.625%, 18/01/27	103 507	0,00	100 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.375%, 25/09/26	101 011	0,00
100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.125%, 17/05/28	96 913	0,00	100 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.050%, 01/09/27	96 308	0,00
300 000 EUR	Erste Group Bank AG, 3.250%, 10/01/29	338 305	0,01	300 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 5.750%, 27/01/28	354 583	0,01
100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.250%, 14/09/29	93 126	0,00	100 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 2.875%, 18/06/32	98 987	0,00
100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 4.000%, 16/01/31	114 319	0,00	200 000 EUR	Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG, 0.875%, 30/01/29	200 653	0,00
100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.250%, 27/01/31	90 047	0,00	500 000 EUR	Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG, 3.250%, 11/01/30	563 902	0,01
200 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.875%, 15/05/34	179 461	0,00	500 000 EUR	Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG, 3.625%, 13/12/27	566 663	0,01
300 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.500%, 12/01/37	239 903	0,00	100 000 EUR	Raiffeisen-Landesbank Steiermark AG, 0.500%, 27/05/41	71 018	0,00
				200 000 USD	Suzano Austria GmbH, 6.000%, 15/01/29	204 520	0,00
				200 000 USD	Suzano Austria GmbH, 5.000%, 15/01/30	193 078	0,00
				100 000 EUR	Telekom Finanzmanagement GmbH, 1.500%, 07/12/26	106 416	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				
Autriche (suite)				Belgique (suite)				
100 000 EUR	UniCredit Bank Austria AG, 0.750%, 25/02/25	107 094	0,00	1 700 000 EUR	European Union, 2.750%, 04/02/33	1 902 431	0,03	
300 000 EUR	UniCredit Bank Austria AG, 0.625%, 16/01/26	315 816	0,01	700 000 EUR	European Union, 3.375%, 04/11/42	807 015	0,01	
500 000 EUR	UniCredit Bank Austria AG, 3.125%, 21/09/29	561 306	0,01	1 000 000 EUR	European Union, 2.500%, 04/10/52	981 658	0,02	
300 000 EUR	UNIQA Insurance Group AG, 1.375%, 09/07/30	287 127	0,00	700 000 EUR	European Union, 3.000%, 04/03/53	759 282	0,01	
Autriche – Total		12 785 364	0,19	100 000 EUR	FLUVIUS System Operator CVBA, 2.875%, 07/05/29	108 941	0,00	
Belgique				100 000 EUR	FLUVIUS System Operator CVBA, 0.625%, 24/11/31	90 250	0,00	
100 000 GBP	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 4.000%, 24/09/25	126 616	0,00	200 000 EUR	ING Belgium SA, 0.625%, 30/05/25	213 175	0,00	
100 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.700%, 31/03/26	109 292	0,00	200 000 EUR	ING Belgium SA, 3.375%, 31/05/27	225 258	0,00	
100 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.125%, 01/07/27	104 294	0,00	500 000 EUR	ING Belgium SA, 1.500%, 19/05/29	518 849	0,01	
400 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.125%, 02/12/27	430 323	0,01	200 000 EUR	KBC Bank NV, 0.010%, 03/12/25	209 199	0,00	
50 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.000%, 17/03/28	53 661	0,00	200 000 EUR	KBC Bank NV, 0.750%, 08/03/26	211 211	0,00	
100 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.500%, 18/04/30	101 590	0,00	200 000 EUR	KBC Bank NV, 3.250%, 30/05/28	225 737	0,01	
100 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.650%, 28/03/31	101 331	0,00	100 000 EUR	KBC Group NV, 1.500%, 29/03/26	107 462	0,00	
300 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.875%, 02/04/32	327 862	0,01	100 000 EUR	KBC Group NV, 4.500%, 06/06/26	111 661	0,00	
100 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.000%, 23/01/35	98 935	0,00	100 000 EUR	KBC Group NV, 0.125%, 10/09/26	104 165	0,00	
250 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.750%, 17/03/36	263 199	0,01	500 000 EUR	KBC Group NV, 4.375%, 23/11/27	565 299	0,01	
500 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3.700%, 02/04/40	564 366	0,01	100 000 EUR	KBC Group NV, 0.750%, 21/01/28	101 646	0,00	
100 000 EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.000%, 13/10/26	104 260	0,00	100 000 EUR	KBC Group NV, 0.125%, 14/01/29	96 662	0,00	
100 000 EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.000%, 29/01/27	100 805	0,00	100 000 EUR	KBC Group NV, 0.750%, 24/01/30	94 863	0,00	
100 000 EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.375%, 08/02/29	98 137	0,00	100 000 EUR	KBC Group NV, 0.750%, 31/05/31	92 623	0,00	
100 000 EUR	Argenta Spaarbank NV, 0.500%, 08/10/41	70 942	0,00	100 000 EUR	KBC Group NV, 4.375%, 06/12/31	116 361	0,00	
200 000 EUR	Belfius Bank SA, 0.375%, 02/09/25	209 347	0,00	Belgique – Total			15 668 606	0,23
100 000 EUR	Belfius Bank SA, 3.875%, 12/06/28	113 112	0,00	Bermudes				
500 000 EUR	Belfius Bank SA, 3.625%, 18/10/28	573 137	0,01	265 000 USD	Aircastle Ltd, 4.250%, 15/06/26	256 443	0,01	
400 000 EUR	Belfius Bank SA, 5.250%, 19/04/33	451 965	0,01	140 000 USD	Arch Capital Group Ltd, 3.635%, 30/06/50	107 352	0,00	
100 000 EUR	bpost SA, 1.250%, 11/07/26	105 344	0,00	100 000 USD	Athene Holding Ltd, 6.150%, 03/04/30	103 432	0,00	
100 000 EUR	Elia Transmission Belgium SA, 1.375%, 14/01/26	106 204	0,00	200 000 USD	Kunlun Energy Co Ltd, 3.750%, 13/05/25	196 650	0,00	
400 000 EUR	Elia Transmission Belgium SA, 0.875%, 28/04/30	385 183	0,01	100 000 USD	Ooredoo International Finance Ltd, 3.875%, 31/01/28	97 232	0,00	
1 500 000 EUR	European Union, 2.000%, 04/10/27	1 632 568	0,03	1 000 000 USD	RenaissanceRe Holdings Ltd, 5.750%, 05/06/33	1 011 860	0,02	
1 700 000 EUR	European Union, 1.625%, 04/12/29	1 792 385	0,03	Bermudes – Total			1 772 969	0,03
				Îles Vierges britanniques				
				300 000 USD	Amipeace Ltd, 1.750%, 09/11/26	276 369	0,00	
				300 000 USD	CCCI Treasure Ltd, 3.425%, perpetual	292 332	0,01	
				300 000 USD	Charming Light Investments Ltd, 4.375%, 21/12/27	285 444	0,00	
				500 000 USD	China Cinda 2020 I Management Ltd, 5.750%, 07/02/27	504 785	0,01	
				200 000 USD	China Cinda Finance 2015 I Ltd, 4.250%, 23/04/25	196 534	0,00	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				
Îles Vierges britanniques (suite)				Canada (suite)				
200 000 USD	China Cinda Finance 2017 I Ltd, 4.400%, 09/03/27	194 396	0,00	1 000 000 USD	Bank of Montreal, 5.300%, 05/06/26	1 010 020	0,02	
500 000 USD	China Great Wall International Holdings V Ltd, 2.875%, 23/11/26	446 890	0,01	800 000 USD	Bank of Montreal, 1.250%, 15/09/26	729 152	0,01	
300 000 USD	China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd, 2.600%, 10/12/24	293 052	0,01	500 000 USD	Bank of Montreal, 0.949%, 22/01/27	461 360	0,01	
200 000 USD	China Southern Power Grid International Finance BVI Co Ltd, 3.500%, 08/05/27	193 884	0,00	600 000 EUR	Bank of Montreal, 0.125%, 26/01/27	608 170	0,01	
500 000 USD	Chinalco Capital Holdings Ltd, 2.125%, 03/06/26	466 525	0,01	500 000 USD	Bank of Montreal, 2.650%, 08/03/27	470 975	0,01	
300 000 USD	CNOOC Finance 2013 Ltd, 2.875%, 30/09/29	275 217	0,00	100 000 EUR	Bank of Montreal, 2.750%, 15/06/27	108 657	0,00	
500 000 USD	CSI MTN Ltd, 3.375%, 21/04/25	487 165	0,01	1 000 000 USD	Bank of Montreal, 5.203%, 01/02/28	1 019 500	0,02	
300 000 USD	CSSC Capital 2015 Ltd, 2.500%, 13/02/25	291 093	0,00	500 000 USD	Bank of Montreal, 5.717%, 25/09/28	518 965	0,01	
200 000 USD	HKT Capital No 2 Ltd, 3.625%, 02/04/25	196 282	0,00	300 000 USD	Bank of Montreal, 3.803%, 15/12/32	276 141	0,00	
500 000 USD	JMH Co Ltd, 2.500%, 09/04/31	424 405	0,01	400 000 EUR	Bank Of Montreal, 0.050%, perpetual	379 178	0,01	
200 000 USD	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 4.750%, 30/07/25	198 944	0,00	100 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 0.500%, 22/01/25	107 117	0,00	
500 000 USD	Pioneer Reward Ltd, 5.250%, 09/08/26	505 235	0,01	300 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 0.010%, 18/03/25	318 272	0,01	
500 000 USD	Rongshi International Finance Ltd, 1.875%, 22/11/26	460 385	0,01	1 500 000 USD	Bank of Nova Scotia, 3.450%, 11/04/25	1 468 845	0,02	
500 000 USD	SF Holding Investment 2021 Ltd, 3.000%, 17/11/28	457 505	0,01	500 000 USD	Bank of Nova Scotia, 3.186%, 03/06/25	488 260	0,01	
500 000 USD	SPIC MTN Co Ltd, 1.625%, 27/07/25	474 155	0,01	1 000 000 USD	Bank of Nova Scotia, 5.450%, 12/06/25	1 004 530	0,02	
200 000 USD	State Grid Overseas Investment BVI Ltd, 3.500%, 04/05/27	194 296	0,00	100 000 GBP	Bank of Nova Scotia, 1.250%, 17/12/25	119 231	0,00	
200 000 EUR	State Grid Overseas Investment BVI Ltd, 2.125%, 02/05/30	196 371	0,00	600 000 USD	Bank of Nova Scotia, 1.300%, 15/09/26	546 786	0,01	
300 000 EUR	State Grid Overseas Investment BVI Ltd, 0.419%, perpetual	283 893	0,00	500 000 CAD	Bank of Nova Scotia, 1.850%, 02/11/26	353 602	0,01	
500 000 USD	TSMC Global Ltd, 1.250%, 23/04/26	462 110	0,01	300 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 0.010%, 14/01/27	303 773	0,00	
400 000 USD	Wharf REIC Finance BVI Ltd, 2.375%, 07/05/25	384 364	0,01	500 000 CAD	Bank of Nova Scotia, 1.400%, 01/11/27	341 919	0,01	
Îles Vierges britanniques – Total			8 441 631	0,13	700 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 3.250%, 18/01/28	783 354	0,01
Canada				500 000 USD	Bank of Nova Scotia, 5.250%, 12/06/28	507 915	0,01	
400 000 CAD	407 International Inc, 2.590%, 25/05/32	269 119	0,00	100 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 0.250%, 01/11/28	95 887	0,00	
100 000 USD	Alimentation Couche-Tard Inc, 3.550%, 26/07/27	96 087	0,00	100 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 0.010%, 14/09/29	93 730	0,00	
500 000 USD	Alimentation Couche-Tard Inc, 3.439%, 13/05/41	378 890	0,01	1 500 000 USD	Bank of Nova Scotia, 4.588%, 04/05/37	1 343 010	0,02	
300 000 CAD	Allied Properties Real Estate Investment Trust, 3.131%, 15/05/28	201 762	0,00	800 000 CAD	Bank of Nova Scotia, 2.950%, perpetual	579 694	0,01	
200 000 CAD	AltaLink LP, 1.509%, 11/09/30	129 094	0,00	500 000 CAD	BCI QuadReal Realty, 1.073%, 04/02/26	354 129	0,01	
500 000 USD	Bank of Montreal, 3.700%, 07/06/25	490 445	0,01	500 000 CAD	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada, 2.200%, 29/05/28	348 825	0,01	
1 000 000 USD	Bank of Montreal, 3.750%, 25/07/25	983 390	0,02	300 000 USD	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada, 4.464%, 01/04/48	269 700	0,00	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Canada (suite)				Canada (suite)			
500 000 CAD	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada, 5.150%, 09/02/53	387 206	0,01	1 000 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 3.000%, 02/12/41	895 030	0,01
50 000 USD	Brookfield Finance Inc, 4.850%, 29/03/29	49 781	0,00	50 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 4.950%, 15/08/45	47 626	0,00
100 000 USD	Brookfield Finance Inc, 4.700%, 20/09/47	87 653	0,00	30 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 6.125%, 15/09/15	33 491	0,00
150 000 USD	Brookfield Finance Inc, 3.500%, 30/03/51	110 047	0,00	300 000 CAD	Choice Properties Real Estate Investment Trust, 2.848%, 21/05/27	215 101	0,00
200 000 USD	Brookfield Finance Inc, 3.625%, 15/02/52	144 234	0,00	200 000 USD	CI Financial Corp, 4.100%, 15/06/51	118 094	0,00
500 000 CAD	Brookfield Infrastructure Finance ULC, 3.410%, 09/10/29	354 308	0,01	500 000 CAD	CU Inc, 3.174%, 05/09/51	304 888	0,00
500 000 CAD	Brookfield Renewable Partners ULC, 3.380%, 15/01/30	354 091	0,01	200 000 USD	Enbridge Inc, 3.700%, 15/07/27	193 262	0,00
100 000 CAD	Brookfield Renewable Partners ULC, 3.330%, 13/08/50	56 806	0,00	500 000 CAD	Enbridge Inc, 3.100%, 21/09/33	328 708	0,01
200 000 CAD	Bruce Power LP, 4.000%, 21/06/30	147 927	0,00	400 000 CAD	Enbridge Pipelines Inc, 4.200%, 12/05/51	260 995	0,00
500 000 USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.144%, 28/04/25	500 130	0,01	300 000 CAD	Fairfax Financial Holdings Ltd, 3.950%, 03/03/31	213 984	0,00
20 000 USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.950%, 23/10/25	18 687	0,00	300 000 USD	Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 2.050%, 10/02/25	289 329	0,00
700 000 EUR	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.375%, 10/03/26	730 223	0,01	300 000 EUR	Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 0.010%, 24/09/25	314 414	0,01
600 000 USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 1.250%, 22/06/26	550 110	0,01	200 000 CAD	Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 1.093%, 21/01/26	141 670	0,00
100 000 CAD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 1.700%, 15/07/26	71 194	0,00	1 000 000 USD	Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 5.147%, 27/11/28	1 026 800	0,02
1 000 000 USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.615%, 17/07/26	1 019 290	0,02	300 000 CAD	Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 1.992%, 28/05/31	212 214	0,00
100 000 EUR	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.010%, 07/10/26	101 906	0,00	300 000 CAD	First Capital Real Estate Investment Trust, 3.447%, 01/03/28	208 924	0,00
700 000 CAD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 2.250%, 07/01/27	498 727	0,01	300 000 USD	Fortis Inc, 3.055%, 04/10/26	284 868	0,00
500 000 USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.001%, 28/04/28	503 170	0,01	400 000 CAD	General Motors Financial of Canada Ltd, 1.750%, 15/04/26	283 473	0,00
400 000 CAD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 2.010%, 21/07/30	289 641	0,00	500 000 CAD	Greater Toronto Airports Authority, 3.150%, 05/10/51	311 706	0,00
500 000 CAD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 1.960%, 21/04/31	354 626	0,01	100 000 EUR	Great-West Lifeco Inc, 4.700%, 16/11/29	118 396	0,00
15 000 USD	Canadian National Railway Co, 6.250%, 01/08/34	16 914	0,00	400 000 CAD	Great-West Lifeco Inc, 2.981%, 08/07/50	235 705	0,00
200 000 USD	Canadian National Railway Co, 3.650%, 03/02/48	166 446	0,00	100 000 EUR	Hsbc Bank Canada, 0.010%, perpetual	102 312	0,00
100 000 USD	Canadian National Railway Co, 2.450%, 01/05/50	65 792	0,00	500 000 CAD	HSBC Bank Canada, 1.782%, 20/05/26	358 187	0,01
100 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 2.900%, 01/02/25	97 401	0,00	400 000 EUR	HSBC Bank Canada, 1.500%, 15/09/27	421 110	0,01
500 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 1.750%, 02/12/26	461 575	0,01	500 000 EUR	HSBC Bank Canada, 3.625%, 07/03/28	569 475	0,01
500 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 2.875%, 15/11/29	450 645	0,01	700 000 CAD	Hydro One Inc, 2.230%, 17/09/31	467 173	0,01
70 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 2.050%, 05/03/30	60 070	0,00	200 000 CAD	Hydro One Inc, 2.710%, 28/02/50	111 809	0,00
500 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 2.450%, 02/12/31	464 220	0,01	300 000 CAD	Inter Pipeline Ltd/AB, 4.232%, 01/06/27	223 824	0,00
20 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 4.800%, 15/09/35	19 624	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Canada (suite)				Canada (suite)			
300 000 USD	Kinross Gold Corp, 4.500%, 15/07/27	293 547	0,00	700 000 USD	Royal Bank of Canada, 0.875%, 20/01/26	649 299	0,01
500 000 CAD	Loblaw Cos Ltd, 2.284%, 07/05/30	338 154	0,01	1 000 000 USD	Royal Bank of Canada, 1.200%, 27/04/26	923 950	0,01
50 000 USD	Magna International Inc, 4.150%, 01/10/25	49 237	0,00	400 000 CAD	Royal Bank of Canada, 1.589%, 04/05/26	285 442	0,00
140 000 USD	Manulife Financial Corp, 2.484%, 19/05/27	129 919	0,00	200 000 EUR	Royal Bank of Canada, 0.050%, 19/06/26	205 991	0,00
300 000 USD	MEGlobal Canada ULC, 5.000%, 18/05/25	296 541	0,00	1 000 000 USD	Royal Bank of Canada, 5.200%, 20/07/26	1 011 470	0,02
200 000 CAD	Metro Inc/CN, 5.030%, 01/12/44	156 392	0,00	500 000 USD	Royal Bank of Canada, 1.400%, 02/11/26	457 595	0,01
500 000 CAD	National Bank of Canada, 2.237%, 04/11/26	357 182	0,01	300 000 EUR	Royal Bank of Canada, 0.010%, 21/01/27	303 780	0,00
500 000 EUR	National Bank of Canada, 3.500%, 25/04/28	565 736	0,01	500 000 EUR	Royal Bank of Canada, 0.125%, 26/04/27	504 604	0,01
400 000 CAD	North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd, 2.800%, 01/06/31	272 201	0,00	1 500 000 USD	Royal Bank of Canada, 3.625%, 04/05/27	1 449 900	0,02
1 000 000 USD	Nutrien Ltd, 4.900%, 27/03/28	1 011 450	0,02	500 000 CAD	Royal Bank of Canada, 4.612%, 26/07/27	381 659	0,01
500 000 USD	Nutrien Ltd, 5.800%, 27/03/53	537 520	0,01	500 000 EUR	Royal Bank of Canada, 2.375%, 13/09/27	542 571	0,01
500 000 CAD	Pembina Pipeline Corp, 3.530%, 10/12/31	346 356	0,01	500 000 CAD	Royal Bank of Canada, 4.632%, 01/05/28	382 432	0,01
500 000 USD	Petronas Energy Canada Ltd, 2.112%, 23/03/28	454 235	0,01	167 000 EUR	Royal Bank of Canada, 4.125%, 05/07/28	190 348	0,00
252 661 CAD	Plenary Properties LTAP LP, 6.288%, 31/01/44	215 253	0,00	100 000 EUR	Royal Bank of Canada, 0.010%, 05/10/28	96 531	0,00
200 000 USD	Rio Tinto Alcan Inc, 7.250%, 15/03/31	228 906	0,00	100 000 EUR	Royal Bank of Canada, 2.125%, 26/04/29	104 093	0,00
15 000 USD	Rio Tinto Alcan Inc, 6.125%, 15/12/33	16 436	0,00	300 000 EUR	Royal Bank of Canada, 0.010%, 27/01/31	269 994	0,00
35 000 USD	Rogers Communications Inc, 3.625%, 15/12/25	33 991	0,00	200 000 CAD	Royal Bank of Canada, 2.140%, 03/11/31	140 761	0,00
100 000 USD	Rogers Communications Inc, 2.900%, 15/11/26	94 994	0,00	500 000 USD	Royal Bank of Canada, 2.300%, 03/11/31	422 640	0,01
500 000 USD	Rogers Communications Inc, 3.200%, 15/03/27	477 315	0,01	100 000 CAD	Royal Bank of Canada, 2.940%, 03/05/32	71 281	0,00
300 000 USD	Rogers Communications Inc, 3.800%, 15/03/32	276 372	0,00	1 000 000 USD	Royal Bank of Canada, 3.875%, 04/05/32	943 610	0,01
700 000 CAD	Rogers Communications Inc, 4.250%, 15/04/32	511 394	0,01	200 000 CAD	Royal Bank of Canada, 1.670%, 28/01/33	135 318	0,00
100 000 CAD	Rogers Communications Inc, 6.750%, 09/11/39	86 852	0,00	400 000 CAD	Saputo Inc, 1.415%, 19/06/26	282 248	0,00
1 000 000 USD	Rogers Communications Inc, 4.500%, 15/03/42	885 800	0,01	50 000 CAD	Scotiabank Capital Trust, 5.650%, 31/12/56	40 249	0,00
50 000 USD	Rogers Communications Inc, 5.000%, 15/03/44	46 910	0,00	500 000 CAD	Sun Life Financial Inc, 2.460%, 18/11/31	356 632	0,01
75 000 USD	Rogers Communications Inc, 4.350%, 01/05/49	63 595	0,00	500 000 CAD	Sun Life Financial Inc, 2.060%, 01/10/35	319 813	0,01
350 000 USD	Rogers Communications Inc, 3.700%, 15/11/49	266 227	0,00	50 000 USD	Telus Corp, 4.600%, 16/11/48	44 731	0,00
500 000 USD	Royal Bank of Canada, 4.950%, 25/04/25	500 310	0,01	100 000 USD	Telus Corp, 4.300%, 15/06/49	83 945	0,00
1 000 000 USD	Royal Bank of Canada, 3.400%, 09/06/25	979 440	0,01	200 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 0.625%, 06/06/25	213 041	0,00
200 000 CAD	Royal Bank of Canada, 4.930%, 16/07/25	152 557	0,00	500 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 3.766%, 06/06/25	491 955	0,01
1 000 000 USD	Royal Bank of Canada, 4.875%, 12/01/26	1 002 580	0,02	250 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 1.150%, 12/06/25	236 720	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				
Canada (suite)				Îles Caïmans				
1 000 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 3.815%, 25/07/25	984 290	0,02	200 000 USD	Alibaba Group Holding Ltd, 4.500%, 28/11/34	188 120	0,00	
200 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 0.750%, 11/09/25	186 668	0,00	500 000 USD	Alibaba Group Holding Ltd, 2.700%, 09/02/41	343 035	0,01	
100 000 CAD	Toronto-Dominion Bank, 1.128%, 09/12/25	71 251	0,00	500 000 USD	Alibaba Group Holding Ltd, 3.150%, 09/02/51	331 210	0,01	
500 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 0.750%, 06/01/26	461 940	0,01	500 000 USD	CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 1.990%, 21/07/25	476 740	0,01	
1 000 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 5.532%, 17/07/26	1 019 450	0,02	200 000 EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1.250%, 13/04/25	213 522	0,00	
500 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 1.250%, 10/09/26	456 960	0,01	200 000 EUR	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 2.000%, 13/04/30	200 295	0,00	
900 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 0.500%, 18/01/27	920 447	0,01	200 000 USD	CK Hutchison International 19 II Ltd, 3.375%, 06/09/49	153 738	0,00	
500 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 2.800%, 10/03/27	472 470	0,01	400 000 USD	CK Hutchison International 20 Ltd, 3.375%, 08/05/50	305 992	0,00	
700 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 0.864%, 24/03/27	724 726	0,01	500 000 USD	CK Hutchison International 21 Ltd, 3.125%, 15/04/41	391 110	0,01	
100 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 2.551%, 03/08/27	108 078	0,00	500 000 USD	DIB Sukuk Ltd, 4.800%, 16/08/28	495 850	0,01	
1 000 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 5.156%, 10/01/28	1 015 000	0,02	1 500 000 USD	DP World Crescent Ltd, 5.500%, 13/09/33	1 535 220	0,02	
200 000 CAD	Toronto-Dominion Bank, 1.888%, 08/03/28	138 363	0,00	500 000 USD	Gaci First Investment Co, 4.875%, 14/02/35	488 575	0,01	
600 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 3.715%, 13/03/30	691 761	0,01	300 000 USD	KSA Sukuk Ltd, 2.969%, 29/10/29	277 365	0,00	
100 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 3.625%, 15/09/31	96 071	0,00	500 000 USD	KSA Sukuk Ltd, 2.250%, 17/05/31	430 180	0,01	
500 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 4.456%, 08/06/32	486 455	0,01	88 848 USD	Lima Metro Line 2 Finance Ltd, 5.875%, 05/07/34	87 959	0,00	
100 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 3.129%, 03/08/32	108 041	0,00	250 000 USD	Park Aerospace Holdings Ltd, 5.500%, 15/02/24	249 593	0,00	
1 000 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 1.200%, perpetual	918 410	0,01	500 000 USD	QNB Finance Ltd, 1.375%, 26/01/26	462 205	0,01	
500 000 CAD	Toyota Credit Canada Inc, 4.450%, 26/01/26	378 731	0,01	200 000 USD	Saudi Electricity Global Sukuk Co 3, 5.500%, 08/04/44	201 974	0,00	
300 000 USD	TransCanada PipeLines Ltd, 4.100%, 15/04/30	285 999	0,00	50 000 GBP	Southern Water Services Finance Ltd, 6.640%, 31/03/26	64 453	0,00	
500 000 CAD	TransCanada PipeLines Ltd, 2.970%, 09/06/31	338 101	0,01	100 000 GBP	Southern Water Services Finance Ltd, 2.375%, 28/05/28	111 607	0,00	
15 000 USD	TransCanada PipeLines Ltd, 5.850%, 15/03/36	15 551	0,00	100 000 GBP	Southern Water Services Finance Ltd, 3.000%, 28/05/37	91 337	0,00	
30 000 USD	TransCanada PipeLines Ltd, 6.200%, 15/10/37	32 033	0,00	400 000 USD	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd, 2.750%, 13/05/30	349 124	0,01	
300 000 USD	TransCanada PipeLines Ltd, 4.750%, 15/05/38	278 520	0,00	150 000 GBP	Thames Water Utilities Finance PLC, 4.625%, 04/06/46	151 295	0,00	
15 000 USD	TransCanada PipeLines Ltd, 7.250%, 15/08/38	17 477	0,00	Îles Caïmans – Total			7 600 499	0,11
200 000 USD	TransCanada PipeLines Ltd, 7.625%, 15/01/39	240 038	0,00	Chili				
325 000 USD	TransCanada PipeLines Ltd, 4.875%, 15/05/48	298 808	0,00	300 000 USD	Banco del Estado de Chile, 2.704%, 09/01/25	290 934	0,01	
100 000 USD	Waste Connections Inc, 3.500%, 01/05/29	95 671	0,00	300 000 USD	Banco Santander Chile, 2.700%, 10/01/25	290 859	0,00	
Canada –				564 504 USD	Celeo Redes Operacion Chile SA, 5.200%, 22/06/47	505 818	0,01	
Total		67 015 811	1,00	300 000 USD	Celulosa Arauco y Constitucion SA, 5.150%, 29/01/50	245 658	0,00	
				200 000 USD	Cencosud SA, 4.375%, 17/07/27	192 480	0,00	
				800 000 USD	Colbun SA, 3.150%, 19/01/32	691 216	0,01	
				300 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3.150%, 14/01/30	267 837	0,00	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Chili (suite)				Danemark (suite)			
1 000 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 5.950%, 08/01/34	1 013 410	0,02	500 000 USD	Danske Bank A/S, 1.549%, perpetual	451 600	0,01
250 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 5.625%, 18/10/43	240 855	0,00	100 000 EUR	ISS Global A/S, 0.875%, 18/06/26	103 568	0,00
400 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 4.500%, 01/08/47	327 244	0,01	100 000 EUR	Jyske Bank A/S, 4.625%, 11/04/26	111 459	0,00
200 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 4.375%, 05/02/49	161 404	0,00	100 000 EUR	Jyske Bank A/S, 0.050%, 02/09/26	103 741	0,00
1 000 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 6.300%, 08/09/53	1 011 270	0,02	100 000 EUR	Jyske Bank A/S, 0.250%, 17/02/28	100 265	0,00
100 000 USD	Enel Americas SA, 4.000%, 25/10/26	97 351	0,00	200 000 EUR	Jyske Realkredit A/S, 3.250%, 01/07/30	226 528	0,01
100 000 USD	Enel Chile SA, 4.875%, 12/06/28	98 498	0,00	800 000 AUD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.150%, perpetual	527 866	0,01
300 000 USD	Inversiones CMPC SA, 3.000%, 06/04/31	255 228	0,00	100 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 0.500%, 10/07/25	105 607	0,00
1 000 000 USD	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 6.500%, 07/11/33	1 061 330	0,02	10 000 000 DKK	Nykredit Realkredit AS, 1.000%, 01/07/26	1 423 400	0,02
500 000 USD	Telefonica Moviles Chile SA, 3.537%, 18/11/31	369 455	0,01	100 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 0.750%, 20/01/27	101 638	0,00
Chili – Total		7 120 847	0,11	100 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 1.375%, 12/07/27	103 387	0,00
Chine				400 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 0.375%, 17/01/28	389 133	0,01
200 000 USD	Bank of China Ltd, 3.875%, 30/06/25	196 954	0,00	100 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 4.625%, 19/01/29	114 178	0,00
500 000 USD	China Life Insurance Overseas Co Ltd, 5.350%, 15/08/33	505 905	0,01	500 000 EUR	Nykredit Realkredit AS, 5.500%, 29/12/32	569 894	0,01
500 000 USD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 1.625%, 28/10/26	459 770	0,01	100 000 EUR	Orsted AS, 3.625%, 01/03/26	110 926	0,00
250 000 USD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 3.538%, 08/11/27	241 435	0,00	100 000 EUR	Orsted AS, 2.250%, 14/06/28	106 154	0,00
500 000 USD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/Singapore, 1.200%, 09/09/25	470 085	0,01	100 000 GBP	Orsted AS, 2.500%, 16/05/33	103 502	0,00
Chine – Total		1 874 149	0,03	100 000 EUR	Orsted AS, 2.875%, 14/06/33	104 439	0,00
République tchèque				100 000 GBP	Orsted AS, 5.125%, 13/09/34	126 900	0,00
400 000 EUR	Ceska sporitelna AS, 5.737%, 08/03/28	456 137	0,01	50 000 GBP	Orsted AS, 5.750%, 09/04/40	66 625	0,00
République tchèque – Total				100 000 GBP	Orsted AS, 5.375%, 13/09/42	127 745	0,00
		456 137	0,01	400 000 EUR	Orsted AS, 1.500%, 31/12/99	338 491	0,01
Danemark				200 000 GBP	Orsted AS, 2.500%, 31/12/99	168 952	0,00
200 000 EUR	AP Moller - Maersk A/S, 1.750%, 16/03/26	213 814	0,01	100 000 EUR	Orsted AS, 3.750%, perpetual	112 837	0,00
500 000 EUR	Berlin Hyp AG, 0.625%, perpetual	500 522	0,01	100 000 EUR	Orsted AS, 4.125%, perpetual	114 817	0,00
100 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 0.375%, 30/06/27	100 708	0,00	100 000 EUR	Sydbank AS, 0.500%, 10/11/26	103 607	0,00
100 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 4.000%, 05/10/28	114 521	0,00	Danemark – Total		8 444 872	0,13
100 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 0.875%, 01/07/29	98 182	0,00	Finlande			
100 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 4.250%, 05/10/33	117 413	0,00	100 000 EUR	Balder Finland Oyj, 1.000%, 18/01/27	93 575	0,00
200 000 GBP	Danske Bank A/S, 4.625%, 13/04/27	252 895	0,01	100 000 EUR	Balder Finland Oyj, 1.375%, 24/05/30	80 152	0,00
100 000 EUR	Danske Bank A/S, 4.500%, 09/11/28	113 989	0,00	100 000 EUR	Balder Finland Oyj, 2.000%, 18/01/31	80 942	0,00
800 000 EUR	Danske Bank A/S, 4.125%, 10/01/31	915 569	0,02	700 000 EUR	Danske Mortgage Bank PLC, 3.125%, 12/01/27	780 732	0,01
				110 000 EUR	Elisa Oyj, 0.250%, 15/09/27	110 093	0,00
				200 000 EUR	Fortum Oyj, 4.000%, perpetual	226 648	0,00
				200 000 EUR	Fortum Oyj, 4.500%, perpetual	234 365	0,01
				100 000 EUR	Kojamo Oyj, 1.875%, 27/05/27	98 749	0,00
				300 000 EUR	Kojamo Oyj, 0.875%, 28/05/29	262 273	0,01
				100 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.375%, 28/05/26	103 780	0,00
				100 000 GBP	Nordea Bank Abp, 6.000%, 02/06/26	128 853	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Finlande (suite)				France			
600 000 USD	Nordea Bank Abp, 1.500%, 30/09/26	547 110	0,01	100 000 EUR	Aéroports de Paris SA, 1.500%, 07/04/25	107 739	0,00
100 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 14/05/27	101 981	0,00	100 000 EUR	Aéroports de Paris SA, 2.750%, 05/06/28	110 072	0,00
100 000 EUR	Nordea Bank Abp, 1.125%, 27/09/27	104 284	0,00	400 000 EUR	Aéroports de Paris SA, 1.125%, 18/06/34	359 908	0,01
200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 4.125%, 05/05/28	228 077	0,00	200 000 EUR	Air Liquide Finance SA, 1.375%, 02/04/30	203 428	0,00
100 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 02/11/28	97 030	0,00	100 000 EUR	Air Liquide Finance SA, 0.625%, 20/06/30	96 773	0,00
100 000 EUR	Nordea Bank Abp, 2.500%, 23/05/29	106 237	0,00	100 000 EUR	Air Liquide Finance SA, 0.375%, 20/09/33	87 325	0,00
300 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 19/03/31	276 539	0,01	100 000 EUR	ALD SA, 4.875%, 06/10/28	116 944	0,00
500 000 EUR	Nordea Bank Abp, 2.875%, 24/08/32	535 104	0,01	100 000 EUR	Alstom SA, 0.250%, 14/10/26	100 066	0,00
200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 4.875%, 23/02/34	229 590	0,01	100 000 EUR	Alstom SA, 0.125%, 27/07/27	96 924	0,00
100 000 EUR	Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj, 0.625%, 23/05/25	106 683	0,00	100 000 EUR	Alstom SA, 0.500%, 27/07/30	89 509	0,00
400 000 EUR	Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj, 0.250%, 18/03/26	417 474	0,01	200 000 EUR	APRR SA, 1.125%, 09/01/26	213 184	0,00
200 000 EUR	Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj, 0.625%, 17/03/27	206 738	0,00	200 000 EUR	APRR SA, 1.250%, 18/01/28	207 727	0,00
500 000 EUR	Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj, 1.000%, 30/03/29	505 886	0,01	300 000 EUR	APRR SA, 1.875%, 03/01/29	315 674	0,01
200 000 EUR	Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj, 3.000%, 20/02/30	223 758	0,00	100 000 EUR	APRR SA, 0.125%, 18/01/29	96 508	0,00
100 000 GBP	Nordic Investment Bank, 1.125%, perpetual	121 221	0,00	100 000 EUR	Arkea Home Loans SFH SA, 0.750%, 05/10/27	102 766	0,00
100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.500%, 12/08/25	105 514	0,00	400 000 EUR	Arkea Home Loans SFH SA, 0.010%, 04/10/30	367 897	0,01
100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.250%, 24/03/26	103 165	0,00	200 000 EUR	Arkea Public Sector SCF SA, 0.125%, 15/01/30	189 125	0,00
100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.600%, 18/01/27	101 351	0,00	500 000 EUR	Arkea Public Sector SCF SA, 3.250%, 10/01/31	568 232	0,01
100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 4.125%, 18/04/27	113 632	0,00	100 000 EUR	Arkema SA, 1.500%, 20/01/25	108 084	0,00
100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.100%, 16/11/27	98 370	0,00	300 000 EUR	Arkema SA, 1.500%, perpetual	306 540	0,01
200 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 4.000%, 13/06/28	228 272	0,00	500 000 EUR	Arval Service Lease SA, 4.250%, perpetual	558 588	0,01
100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.375%, 16/06/28	97 378	0,00	100 000 EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.125%, 20/04/26	106 007	0,00
100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 0.375%, 08/12/28	95 497	0,00	100 000 EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.375%, 22/01/30	101 513	0,00
100 000 EUR	OP Corporate Bank plc, 1.625%, 09/06/30	105 569	0,00	100 000 EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 2.750%, 02/09/32	107 214	0,00
700 000 EUR	OP Mortgage Bank, 2.750%, 22/06/26	771 051	0,01	300 000 EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 3.250%, 19/01/33	333 267	0,01
300 000 EUR	OP Mortgage Bank, 0.050%, 21/04/28	295 575	0,01	300 000 EUR	AXA Bank Europe SCF, 0.010%, 22/01/27	304 847	0,01
300 000 EUR	OP Mortgage Bank, 0.050%, 25/03/31	271 688	0,01	500 000 EUR	AXA Bank Europe SCF, 0.625%, 16/02/28	506 863	0,01
400 000 EUR	Sampo Oyj, 2.500%, 03/09/52	371 317	0,01	400 000 EUR	AXA SA, 3.750%, 12/10/30	465 986	0,01
100 000 EUR	Sato Oyj, 1.375%, 24/02/28	92 154	0,00	25 000 USD	AXA SA, 8.600%, 15/12/30	30 093	0,00
Finlande – Total		8 858 407	0,13	200 000 EUR	AXA SA, 1.375%, 07/10/41	182 479	0,00
				200 000 EUR	AXA SA, 4.250%, 10/03/43	218 146	0,01
				200 000 EUR	AXA SA, 3.250%, 28/05/49	211 859	0,00
				500 000 EUR	AXA SA, 5.500%, perpetual	591 529	0,01
				600 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.010%, 07/03/25	635 039	0,01
				100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.750%, 17/07/25	105 950	0,00
				400 000 GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 5.000%, 19/01/26	511 399	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
1 000 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.010%, 11/05/26	1 026 419	0,02	1 000 000 USD	BNP Paribas SA, 1.323%, 13/01/27	922 690	0,02
200 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.750%, 08/06/26	207 926	0,00	150 000 USD	BNP Paribas SA, 4.625%, 13/03/27	147 052	0,00
100 000 GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.500%, 07/10/26	117 654	0,00	400 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.250%, 13/04/27	410 051	0,01
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.875%, 04/11/26	105 732	0,00	300 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.375%, 14/10/27	305 715	0,01
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.625%, 31/03/27	107 328	0,00	100 000 GBP	BNP Paribas SA, 1.875%, 14/12/27	114 763	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.250%, 26/05/27	103 613	0,00	600 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 19/02/28	603 119	0,01
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.625%, 19/11/27	99 396	0,00	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 30/05/28	100 022	0,00
100 000 GBP	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.875%, 07/12/27	112 056	0,00	200 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 01/09/28	198 192	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.875%, 26/01/28	112 094	0,00	500 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.375%, 13/01/29	571 833	0,01
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.500%, 25/05/28	105 979	0,00	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.125%, 17/04/29	99 712	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.250%, 29/06/28	97 296	0,00	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.375%, 28/05/29	99 343	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.375%, 16/07/28	102 621	0,00	500 000 USD	BNP Paribas SA, 5.335%, 12/06/29	507 565	0,01
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.250%, 19/07/28	95 623	0,00	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 3.625%, 01/09/29	110 869	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.625%, 06/11/29	104 966	0,00	500 000 USD	BNP Paribas SA, 2.159%, 15/09/29	435 230	0,01
600 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.000%, 21/11/29	686 485	0,01	200 000 USD	BNP Paribas SA, 5.198%, 10/01/30	200 384	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.750%, 17/01/30	93 500	0,00	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 19/01/30	94 737	0,00
600 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.125%, 18/09/30	695 983	0,01	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.875%, 11/07/30	95 210	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.625%, 21/02/31	90 413	0,00	100 000 GBP	BNP Paribas SA, 2.000%, 24/05/31	115 596	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.125%, 19/11/31	89 318	0,00	200 000 GBP	BNP Paribas SA, 1.250%, 13/07/31	198 708	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.125%, 19/01/32	92 071	0,00	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.125%, 15/01/32	100 730	0,00
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.875%, 16/06/32	109 110	0,00	400 000 GBP	BNP Paribas SA, 5.750%, 13/06/32	537 736	0,01
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.000%, 26/01/33	113 376	0,00	200 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.125%, 26/09/32	231 407	0,01
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.750%, 01/02/33	112 760	0,00	500 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.750%, 13/11/32	585 967	0,01
500 000 USD	BNP Paribas SA, 2.871%, 19/04/32	423 830	0,01	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.625%, 03/12/32	86 054	0,00
1 000 000 EUR	BNP Paribas Home Loan SFH SA, 3.000%, 25/05/28	1 118 547	0,02	300 000 USD	BNP Paribas SA, 4.375%, 01/03/33	281 607	0,01
100 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.625%, 23/02/26	107 117	0,00	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.875%, 31/08/33	94 797	0,00
500 000 USD	BNP Paribas SA, 2.219%, 09/06/26	477 410	0,01	100 000 GBP	BNP Paribas SA, 2.875%, perpetual	116 360	0,00
200 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.125%, 11/06/26	210 308	0,00	800 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.250%, perpetual	913 899	0,02
100 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.250%, 11/01/27	107 333	0,00	200 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.125%, perpetual	232 927	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
300 000 EUR	Bouygues SA, 1.125%, 24/07/28	308 807	0,01	400 000 EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 0.750%, 07/07/28	391 939	0,01
500 000 EUR	Bouygues SA, 3.875%, 17/07/31	576 058	0,01	300 000 EUR	Capgemini SE, 0.625%, 23/06/25	318 361	0,01
200 000 EUR	Bouygues SA, 4.625%, 07/06/32	242 707	0,01	100 000 EUR	Capgemini SE, 1.625%, 15/04/26	106 972	0,00
100 000 EUR	Bouygues SA, 3.250%, 30/06/37	108 077	0,00	100 000 EUR	Capgemini SE, 2.000%, 15/04/29	105 707	0,00
100 000 EUR	Bouygues SA, 5.375%, 30/06/42	131 242	0,00	100 000 EUR	Capgemini SE, 2.375%, 15/04/32	104 639	0,00
300 000 USD	BPCE SA, 2.375%, 14/01/25	290 070	0,01	100 000 EUR	Carmila SA, 2.125%, 07/03/28	102 398	0,00
100 000 EUR	BPCE SA, 1.000%, 01/04/25	107 028	0,00	100 000 EUR	Carrefour SA, 1.750%, 04/05/26	107 140	0,00
100 000 EUR	BPCE SA, 0.625%, 28/04/25	106 367	0,00	200 000 EUR	Carrefour SA, 1.875%, 30/10/26	213 564	0,00
100 000 EUR	BPCE SA, 0.250%, 15/01/26	103 826	0,00	100 000 EUR	Carrefour SA, 1.000%, 17/05/27	103 190	0,00
400 000 EUR	BPCE SA, 0.375%, 02/02/26	416 515	0,01	500 000 EUR	Carrefour SA, 4.125%, 12/10/28	574 694	0,01
100 000 GBP	BPCE SA, 1.375%, 23/12/26	116 412	0,00	150 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 4.000%, 24/10/25	168 609	0,00
100 000 EUR	BPCE SA, 0.010%, 14/01/27	100 688	0,00	200 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 0.010%, 15/07/26	205 949	0,00
100 000 EUR	BPCE SA, 1.750%, 26/04/27	105 746	0,00	200 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 0.225%, 14/09/26	206 205	0,00
250 000 USD	BPCE SA, 3.500%, 23/10/27	234 540	0,01	200 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 0.375%, 09/04/27	204 539	0,00
100 000 EUR	BPCE SA, 0.500%, 14/01/28	100 830	0,00	400 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 0.010%, 25/10/27	398 240	0,01
700 000 EUR	BPCE SA, 3.500%, 25/01/28	781 792	0,01	100 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 0.010%, 10/11/27	99 396	0,00
300 000 EUR	BPCE SA, 4.375%, 13/07/28	342 583	0,01	500 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 0.010%, 16/04/29	478 529	0,01
300 000 USD	BPCE SA, 2.700%, 01/10/29	264 774	0,01	800 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 3.375%, 16/09/31	916 356	0,02
100 000 EUR	BPCE SA, 0.625%, 15/01/30	94 597	0,00	100 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 0.600%, 25/10/41	73 097	0,00
100 000 EUR	BPCE SA, 0.250%, 14/01/31	88 935	0,00	300 000 EUR	Cie de Financement Foncier SA, 0.010%, perpetual	234 147	0,01
200 000 EUR	BPCE SA, 0.750%, 03/03/31	183 317	0,00	100 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.000%, 17/03/25	107 476	0,00
200 000 EUR	BPCE SA, 1.000%, 14/01/32	182 186	0,00	100 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.125%, 23/03/26	105 813	0,00
100 000 EUR	BPCE SA, 2.375%, 26/04/32	102 696	0,00	500 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 2.375%, 04/10/27	541 555	0,01
500 000 USD	BPCE SA, 3.116%, 19/10/32	405 515	0,01	500 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 3.875%, 29/11/30	570 756	0,01
300 000 EUR	BPCE SA, 4.000%, 29/11/32	346 222	0,01	200 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.875%, 03/09/25	212 811	0,00
500 000 GBP	BPCE SA, 2.500%, 30/11/32	558 432	0,01	600 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.010%, 02/11/28	584 601	0,01
100 000 EUR	BPCE SA, 1.750%, 02/02/34	97 277	0,00	100 000 EUR	CNP Assurances SACA, 4.250%, 05/06/45	109 984	0,00
100 000 EUR	BPCE SA, 4.750%, 14/06/34	117 468	0,00	100 000 EUR	CNP Assurances SACA, 2.000%, 27/07/50	95 784	0,00
300 000 USD	BPCE SA, 3.582%, perpetual	212 862	0,00	400 000 EUR	CNP Assurances SACA, 2.500%, 30/06/51	385 081	0,01
100 000 EUR	BPCE SFH SA, 1.000%, 24/02/25	107 580	0,00	200 000 EUR	Cofiroute SA, 0.375%, 07/02/25	213 518	0,00
400 000 EUR	BPCE SFH SA, 0.125%, 31/03/25	425 003	0,01	100 000 EUR	Cofiroute SA, 1.125%, 13/10/27	103 948	0,00
500 000 EUR	BPCE SFH SA, 0.010%, 08/11/26	511 707	0,01	100 000 EUR	Cofiroute SA, 1.000%, 19/05/31	95 663	0,00
200 000 EUR	BPCE SFH SA, 0.750%, 27/11/26	208 675	0,00	100 000 EUR	Council Of Europe Development Bank, 0.375%, 27/03/25	106 861	0,00
800 000 EUR	BPCE SFH SA, 3.125%, 20/07/27	895 253	0,02	200 000 EUR	Covivio SA, 1.625%, 23/06/30	195 852	0,00
500 000 EUR	BPCE SFH SA, 0.010%, 29/01/29	480 998	0,01				
700 000 EUR	BPCE SFH SA, 3.000%, 17/10/29	781 738	0,01				
500 000 EUR	BPCE SFH SA, 0.375%, 21/01/32	455 243	0,01				
100 000 EUR	BPCE SFH SA, 0.375%, 18/03/41	70 688	0,00				
100 000 EUR	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA, 3.250%, 26/06/28	113 493	0,00				
200 000 EUR	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 0.010%, 27/11/26	204 502	0,00				
400 000 EUR	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 0.125%, 30/04/27	405 495	0,01				
200 000 EUR	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 0.010%, 07/02/28	198 039	0,00				
300 000 EUR	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 0.010%, 08/10/29	283 585	0,01				
500 000 EUR	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.375%, 28/06/32	572 750	0,01				
100 000 EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 6.000%, 23/01/27	118 679	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
100 000 EUR	Covivio SA, 4.625%, 05/06/32	114 461	0,00	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.125%, 24/02/29	100 617	0,00
200 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 1.500%, 06/10/31	180 217	0,00	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.750%, 05/03/29	204 044	0,00
200 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 2.625%, 29/01/48	205 370	0,00	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.000%, 03/07/29	98 448	0,00
100 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 4.250%, perpetual	109 839	0,00	400 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.250%, 11/07/29	455 876	0,01
200 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.500%, 03/04/25	213 544	0,00	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.500%, 21/09/29	192 755	0,00
200 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.750%, 05/05/27	207 117	0,00	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.625%, 05/06/30	213 471	0,00
500 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.010%, 12/04/28	492 287	0,01	500 000 GBP	Credit Agricole SA, 1.874%, 09/12/31	568 197	0,01
500 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 3.375%, 04/09/28	566 514	0,01	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.875%, 14/01/32	90 855	0,00
700 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 3.125%, 16/08/29	786 973	0,01	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.125%, 12/07/32	92 588	0,00
100 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 1.375%, 03/02/32	98 703	0,00	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.000%, 18/01/33	116 178	0,00
500 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.375%, 01/02/33	441 877	0,01	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 5.500%, 28/08/33	115 988	0,00
200 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 3.250%, 08/06/33	226 842	0,01	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.500%, 22/04/34	101 544	0,00
100 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.875%, 06/05/34	90 149	0,00	500 000 USD	Credit Agricole SA, 2.811%, 11/01/41	344 105	0,01
200 000 EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 1.500%, 28/09/38	179 614	0,00	200 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.375%, 17/01/25	215 840	0,00
200 000 EUR	Credit Agricole Public Sector SCF SA, 0.875%, 02/08/27	207 131	0,00	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.010%, 28/01/26	103 467	0,00
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.375%, 13/03/25	107 727	0,00	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.625%, 15/04/26	106 241	0,00
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.000%, 18/09/25	106 680	0,00	500 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 3.375%, 19/09/27	554 595	0,01
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.375%, 21/10/25	210 548	0,00	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 1.250%, 11/06/29	100 280	0,00
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.000%, 22/04/26	106 588	0,00	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.750%, 18/01/30	94 936	0,00
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.875%, 20/12/26	106 346	0,00	100 000 EUR	Credit Mutuel Arkea SA, 0.875%, 11/03/33	87 775	0,00
250 000 USD	Credit Agricole SA, 4.125%, 10/01/27	242 740	0,01	500 000 EUR	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.125%, 09/04/25	530 978	0,01
500 000 USD	Credit Agricole SA, 1.247%, 26/01/27	460 265	0,01	100 000 EUR	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.625%, 02/02/26	105 424	0,00
500 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.875%, 22/04/27	532 651	0,01	400 000 EUR	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.625%, 04/03/27	413 943	0,01
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.375%, 03/05/27	209 358	0,00	500 000 EUR	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 3.250%, 20/04/29	564 973	0,01
500 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.375%, 28/07/27	556 191	0,01	300 000 EUR	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.010%, 06/05/31	270 451	0,01
100 000 GBP	Credit Agricole SA, 5.750%, 29/11/27	130 449	0,00	500 000 EUR	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 3.125%, 22/02/33	562 913	0,01
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.125%, 09/12/27	196 014	0,00	100 000 EUR	Danone SA, 1.208%, 03/11/28	102 924	0,00
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.625%, 12/01/28	101 583	0,00	100 000 EUR	Danone SA, 0.395%, 10/06/29	97 078	0,00
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.375%, 20/04/28	97 593	0,00	500 000 EUR	Danone SA, 0.520%, 09/11/30	468 808	0,01
				500 000 EUR	Danone SA, 3.470%, perpetual	567 078	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
100 000 EUR	Dassault Systemes SE, 0.125%, 16/09/26	102 950	0,00	500 000 EUR	Engie SA, 3.875%, 06/01/31	570 911	0,01
500 000 EUR	Dassault Systemes SE, 0.375%, 16/09/29	486 593	0,01	400 000 EUR	Engie SA, 2.125%, 30/03/32	405 385	0,01
200 000 EUR	Dexia Credit Local SA, 0.500%, 17/01/25	214 609	0,00	100 000 EUR	Engie SA, 4.000%, 11/01/35	114 761	0,00
200 000 GBP	Dexia Credit Local SA, 2.125%, 12/02/25	247 240	0,01	100 000 EUR	Engie SA, 1.500%, 13/03/35	89 826	0,00
500 000 USD	Dexia Credit Local SA, 1.125%, 09/04/26	463 240	0,01	100 000 EUR	Engie SA, 1.000%, 26/10/36	82 138	0,00
300 000 GBP	Dexia Credit Local SA, 0.250%, 10/12/26	341 198	0,01	100 000 EUR	Engie SA, 1.375%, 21/06/39	80 159	0,00
300 000 EUR	Dexia Credit Local SA, 0.010%, 22/01/27	306 544	0,01	500 000 GBP	Engie SA, 5.625%, 03/04/53	677 849	0,01
200 000 EUR	Dexia Credit Local SA, 0.010%, 21/01/28	199 484	0,00	100 000 GBP	Engie SA, 5.000%, 01/10/60	126 284	0,00
500 000 EUR	Dexia Credit Local SA, 3.125%, 01/06/28	565 730	0,01	100 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.125%, 27/05/25	105 588	0,00
100 000 EUR	Edenred SE, 1.875%, 06/03/26	107 573	0,00	300 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.375%, 05/01/26	314 666	0,01
100 000 EUR	Edenred SE, 1.375%, 18/06/29	101 592	0,00	100 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.375%, 27/11/27	101 038	0,00
300 000 EUR	Edenred SE, 3.625%, 13/06/31	337 141	0,01	100 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.500%, 05/06/28	100 768	0,00
400 000 EUR	Electricite de France SA, 1.000%, 13/10/26	418 282	0,01	100 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.750%, 27/11/31	95 271	0,00
200 000 EUR	Electricite de France SA, 4.125%, 25/03/27	227 998	0,01	300 000 EUR	Firmenich Productions Participations SAS, 1.750%, 30/04/30	306 902	0,01
500 000 EUR	Electricite de France SA, 4.375%, 12/10/29	584 796	0,01	100 000 EUR	Gecina SA, 1.375%, 30/06/27	105 185	0,00
300 000 EUR	Electricite de France SA, 2.000%, 02/10/30	305 410	0,01	500 000 EUR	Gecina SA, 0.875%, 25/01/33	456 044	0,01
500 000 EUR	Electricite de France SA, 4.250%, 25/01/32	579 124	0,01	100 000 EUR	Gecina SA, 1.625%, 29/05/34	95 987	0,00
150 000 USD	Electricite de France SA, 6.950%, 26/01/39	170 931	0,00	100 000 EUR	Gecina SA, 0.875%, 30/06/36	81 652	0,00
125 000 USD	Electricite de France SA, 5.600%, 27/01/40	124 325	0,00	100 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.625%, 27/11/27	103 552	0,00
500 000 GBP	Electricite de France SA, 5.500%, 17/10/41	627 010	0,01	200 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 0.625%, 14/09/28	195 132	0,00
200 000 USD	Electricite de France SA, 4.875%, 22/01/44	180 118	0,00	500 000 EUR	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1.475%, 18/01/31	473 470	0,01
500 000 USD	Electricite de France SA, 5.000%, 21/09/48	456 990	0,01	100 000 EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.100%, 03/09/27	99 118	0,00
100 000 EUR	Electricite de France SA, 2.000%, 09/12/49	73 447	0,00	100 000 EUR	ICADE, 1.625%, 28/02/28	102 718	0,00
400 000 GBP	Electricite de France SA, 5.625%, 25/01/53	499 910	0,01	100 000 EUR	Imerys SA, 1.500%, 15/01/27	103 559	0,00
200 000 GBP	Electricite de France SA, 6.000%, 23/01/14	248 425	0,01	300 000 EUR	Imerys SA, 1.000%, 15/07/31	260 950	0,01
500 000 EUR	ELO SACA, 6.000%, 22/03/29	561 195	0,01	100 000 EUR	Indigo Group SAS, 1.625%, 19/04/28	102 753	0,00
100 000 EUR	Engie SA, 0.010%, 04/03/27	100 373	0,00	200 000 EUR	JCDecaux SE, 1.625%, 07/02/30	192 545	0,00
200 000 EUR	Engie SA, 0.375%, 11/06/27	201 833	0,00	100 000 EUR	Kering SA, 1.250%, 10/05/26	106 169	0,00
100 000 EUR	Engie SA, 0.375%, 21/06/27	100 849	0,00	200 000 EUR	Kering SA, 3.625%, 05/09/27	225 941	0,01
100 000 EUR	Engie SA, 1.500%, 27/03/28	103 949	0,00	100 000 EUR	Kering SA, 3.250%, 27/02/29	112 351	0,00
300 000 EUR	Engie SA, 1.750%, 27/03/28	314 385	0,01	400 000 EUR	Kering SA, 1.875%, 05/05/30	416 745	0,01
100 000 EUR	Engie SA, 1.375%, 28/02/29	101 704	0,00	200 000 EUR	Kering SA, 3.625%, 05/09/31	228 473	0,01
500 000 EUR	Engie SA, 3.500%, 27/09/29	561 858	0,01	100 000 EUR	Kering SA, 3.375%, 27/02/33	112 527	0,00
100 000 EUR	Engie SA, 3.625%, 11/01/30	113 446	0,00	200 000 EUR	Kering SA, 3.875%, 05/09/35	231 616	0,01
				200 000 EUR	Klepierre SA, 2.000%, 12/05/29	207 270	0,00
				100 000 EUR	Klepierre SA, 0.625%, 01/07/30	92 057	0,00
				100 000 EUR	Klepierre SA, 1.625%, 13/12/32	94 515	0,00
				300 000 EUR	La Banque Postale Home Loan SFH SA, 0.875%, 07/02/28	308 217	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
500 000 EUR	La Banque Postale Home Loan SFH SA, 3.000%, 31/01/31	560 273	0,01	100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.500%, 18/05/26	107 226	0,00
500 000 EUR	La Banque Postale Home Loan SFH SA, 0.250%, 12/02/35	412 355	0,01	100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.250%, 02/11/28	112 139	0,00
100 000 EUR	La Banque Postale SA, 0.500%, 17/06/26	105 546	0,00	400 000 EUR	Pernod Ricard SA, 0.125%, 04/10/29	377 203	0,01
100 000 EUR	La Banque Postale SA, 1.375%, 24/04/29	100 068	0,00	100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.750%, 08/04/30	102 503	0,00
100 000 EUR	La Banque Postale SA, 0.750%, 23/06/31	90 605	0,00	100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.750%, 02/11/32	115 700	0,00
600 000 EUR	La Banque Postale SA, 1.000%, perpetual	609 813	0,01	100 000 EUR	Praemia Healthcare SACA, 0.875%, 04/11/29	91 445	0,00
100 000 EUR	La Mondiale SAM, 2.125%, 23/06/31	95 342	0,00	100 000 EUR	Praemia Healthcare SACA, 1.375%, 17/09/30	91 166	0,00
100 000 EUR	La Poste SA, 0.625%, 21/10/26	103 478	0,00	500 000 EUR	RCI Banque SA, 0.500%, 14/07/25	527 658	0,01
200 000 EUR	La Poste SA, 0.375%, 17/09/27	200 993	0,00	100 000 EUR	RCI Banque SA, 1.750%, 10/04/26	106 097	0,00
500 000 EUR	La Poste SA, 0.010%, 18/07/29	467 030	0,01	500 000 EUR	RCI Banque SA, 4.625%, 02/10/26	566 697	0,01
100 000 EUR	La Poste SA, 1.375%, 21/04/32	95 829	0,00	60 000 EUR	RCI Banque SA, 1.125%, 15/01/27	62 027	0,00
500 000 EUR	La Poste SA, 4.000%, 12/06/35	590 209	0,01	70 000 EUR	RCI Banque SA, 4.875%, 21/09/28	81 813	0,00
100 000 EUR	La Poste SA, 0.625%, 18/01/36	81 470	0,00	96 000 EUR	RCI Banque SA, 4.875%, 02/10/29	111 519	0,00
100 000 EUR	Legrand SA, 0.625%, 24/06/28	100 961	0,00	100 000 EUR	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 0.010%, 09/09/27	99 309	0,00
500 000 EUR	Legrand SA, 3.500%, 29/05/29	570 684	0,01	200 000 EUR	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 2.750%, 20/06/29	218 137	0,00
200 000 EUR	Legrand SA, 0.750%, 20/05/30	193 621	0,00	200 000 EUR	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 0.625%, 08/07/32	181 580	0,00
100 000 EUR	Legrand SA, 1.875%, 06/07/32	103 320	0,00	100 000 EUR	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 0.750%, 12/01/34	88 548	0,00
500 000 EUR	L'Oreal SA, 2.875%, 19/05/28	555 120	0,01	100 000 EUR	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 3.750%, 04/07/35	115 406	0,00
100 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.750%, 07/04/25	107 126	0,00	100 000 EUR	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 2.000%, 18/04/36	95 483	0,00
300 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.010%, 11/02/26	312 403	0,01	100 000 EUR	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 1.125%, 09/09/49	72 165	0,00
100 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.125%, 11/02/28	99 871	0,00	500 000 EUR	Sanofi SA, 1.000%, 21/03/26	530 646	0,01
400 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.250%, 07/09/29	449 995	0,01	100 000 EUR	Sanofi SA, 1.125%, 05/04/28	103 772	0,00
100 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.375%, 11/02/31	94 280	0,00	100 000 USD	Sanofi SA, 3.625%, 19/06/28	98 033	0,00
100 000 EUR	Orange SA, 1.000%, 12/05/25	106 956	0,00	100 000 EUR	Sanofi SA, 0.875%, 21/03/29	100 994	0,00
100 000 EUR	Orange SA, 0.010%, 29/06/26	102 859	0,00	500 000 EUR	Sanofi SA, 1.250%, 06/04/29	514 038	0,01
200 000 EUR	Orange SA, 0.010%, 04/09/26	204 804	0,00	100 000 EUR	Sanofi SA, 1.375%, 21/03/30	102 014	0,00
100 000 EUR	Orange SA, 1.500%, 09/09/27	105 949	0,00	100 000 EUR	Schlumberger Finance France SAS, 1.000%, 18/02/26	105 709	0,00
100 000 EUR	Orange SA, 1.375%, 20/03/28	104 142	0,00	100 000 EUR	Schneider Electric SE, 0.875%, 13/12/26	105 130	0,00
100 000 EUR	Orange SA, 2.000%, 15/01/29	106 128	0,00				
100 000 EUR	Orange SA, 0.125%, 16/09/29	95 382	0,00				
100 000 EUR	Orange SA, 1.375%, 16/01/30	101 528	0,00				
25 000 USD	Orange SA, 9.000%, 01/03/31	30 907	0,00				
100 000 EUR	Orange SA, 3.625%, 16/11/31	115 267	0,00				
500 000 GBP	Orange SA, 3.250%, 15/01/32	593 604	0,01				
300 000 EUR	Orange SA, 1.625%, 07/04/32	299 873	0,01				
500 000 EUR	Orange SA, 2.375%, 18/05/32	529 520	0,01				
43 000 EUR	Orange SA, 8.125%, 28/01/33	66 600	0,00				
400 000 EUR	Orange SA, 0.625%, 16/12/33	353 581	0,01				
100 000 EUR	Orange SA, 0.750%, 29/06/34	87 958	0,00				
50 000 USD	Orange SA, 5.375%, 13/01/42	50 995	0,00				
100 000 EUR	Orange SA, 1.750%, perpetual	97 957	0,00				
100 000 EUR	Orange SA, 2.375%, perpetual	107 412	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
400 000 EUR	Schneider Electric SE, 1.000%, 09/04/27	418 481	0,01	1 000 000 USD	Societe Generale SA, 6.691%, 10/01/34	1 054 670	0,02
100 000 EUR	Schneider Electric SE, 1.500%, 15/01/28	105 276	0,00	500 000 EUR	Societe Generale SFH SA, 0.010%, 02/12/26	511 133	0,01
100 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.250%, 12/06/28	112 779	0,00	400 000 EUR	Societe Generale SFH SA, 0.750%, 29/01/27	415 901	0,01
100 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.500%, 12/06/33	114 765	0,00	100 000 EUR	Societe Generale SFH SA, 0.750%, 19/01/28	102 207	0,00
400 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.375%, 13/04/34	454 811	0,01	700 000 EUR	Societe Generale SFH SA, 0.125%, 02/02/29	678 423	0,01
200 000 EUR	SCOR SE, 1.375%, 17/09/51	174 789	0,00	100 000 EUR	Societe Generale SFH SA, 0.010%, 29/10/29	94 402	0,00
100 000 EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, 1.500%, 29/05/25	107 461	0,00	500 000 EUR	Societe Generale SFH SA, 0.010%, 05/02/31	454 127	0,01
100 000 EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, 0.500%, 21/04/28	99 103	0,00	100 000 EUR	Sodexo SA, 0.750%, 27/04/25	106 739	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 1.125%, 23/01/25	107 357	0,00	100 000 EUR	Sodexo SA, 1.000%, 27/04/29	100 346	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 2.625%, 27/02/25	108 842	0,00	200 000 EUR	Stellantis NV, 2.000%, 20/03/25	216 655	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 24/02/26	103 462	0,00	100 000 EUR	Stellantis NV, 1.125%, 18/09/29	99 174	0,00
200 000 EUR	Societe Generale SA, 1.125%, 21/04/26	213 244	0,00	500 000 EUR	TDF Infrastructure SASU, 5.625%, 21/07/28	580 681	0,01
100 000 USD	Societe Generale SA, 4.250%, 19/08/26	96 044	0,00	100 000 EUR	Teleperformance SE, 1.875%, 02/07/25	107 043	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 17/11/26	103 697	0,00	100 000 EUR	Teleperformance SE, 3.750%, 24/06/29	110 086	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.750%, 25/01/27	101 599	0,00	100 000 EUR	Terega SA, 0.875%, 17/09/30	93 427	0,00
400 000 EUR	Societe Generale SA, 0.250%, 08/07/27	397 798	0,01	300 000 EUR	Terega SASU, 0.625%, 27/02/28	295 488	0,01
600 000 EUR	Societe Generale SA, 4.000%, 16/11/27	678 578	0,01	100 000 EUR	Tikehau Capital SCA, 2.250%, 14/10/26	106 292	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.625%, 02/12/27	101 269	0,00	300 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.023%, 04/03/27	313 341	0,01
300 000 GBP	Societe Generale SA, 1.250%, 07/12/27	331 931	0,01	500 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.491%, 08/04/27	528 001	0,01
200 000 EUR	Societe Generale SA, 1.375%, 13/01/28	204 908	0,00	200 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.696%, 31/05/28	201 247	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 18/02/28	97 567	0,00	300 000 USD	TotalEnergies Capital International SA, 3.455%, 19/02/29	289 623	0,01
200 000 EUR	Societe Generale SA, 0.875%, 22/09/28	200 512	0,00	300 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.491%, 04/09/30	302 484	0,01
1 000 000 USD	Societe Generale SA, 6.446%, 10/01/29	1 036 250	0,02	100 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.952%, 18/05/31	96 080	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 1.750%, 22/03/29	100 387	0,00	100 000 GBP	TotalEnergies Capital International SA, 1.405%, 03/09/31	106 456	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 2.625%, 30/05/29	107 422	0,00	200 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.994%, 08/04/32	204 524	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.500%, 12/06/29	95 796	0,00	100 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.618%, 18/05/40	86 606	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.875%, 24/09/29	94 493	0,00	300 000 USD	TotalEnergies Capital International SA, 2.986%, 29/06/41	234 282	0,01
400 000 EUR	Societe Generale SA, 4.750%, 28/09/29	460 454	0,01	200 000 USD	TotalEnergies Capital International SA, 3.127%, 29/05/50	147 808	0,00
100 000 EUR	Societe Generale SA, 4.250%, 16/11/32	117 454	0,00	200 000 USD	TotalEnergies Capital International SA, 3.386%, 29/06/60	149 672	0,00
				50 000 USD	TotalEnergies Capital SA, 3.883%, 11/10/28	49 125	0,00
				100 000 EUR	TotalEnergies SE, 3.369%, perpetual	107 608	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				
France (suite)				France (suite)				
100 000 EUR	TotalEnergies SE, 1.625%, perpetual	98 873	0,00	400 000 EUR	WPP Finance SA, 2.375%, 19/05/27	433 266	0,01	
100 000 EUR	TotalEnergies SE, 2.125%, perpetual	88 420	0,00	140 000 EUR	WPP Finance SA, 4.125%, perpetual	159 521	0,00	
500 000 EUR	TotalEnergies SE, 3.250%, perpetual	456 105	0,01	France – Total			113 286 271	1,70
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.125%, 09/04/25	108 322	0,00	Allemagne				
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.125%, 15/09/25	106 445	0,00	400 000 EUR	Aareal Bank AG, 0.010%, 03/08/26	410 523	0,01	
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.375%, 09/03/26	105 982	0,00	100 000 EUR	Aareal Bank AG, 0.050%, 02/09/26	98 680	0,00	
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0.750%, 25/10/28	99 066	0,00	500 000 EUR	Aareal Bank AG, 2.250%, 01/02/27	542 781	0,01	
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.500%, 29/05/29	100 331	0,00	500 000 EUR	adidas AG, 3.000%, 21/11/25	552 927	0,01	
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.625%, 09/04/30	107 086	0,00	100 000 EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.125%, 25/11/25	105 817	0,00	
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 4.125%, 11/12/30	113 986	0,00	100 000 EUR	Albemarle New Holding GmbH, 1.625%, 25/11/28	100 868	0,00	
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.875%, 15/01/31	99 206	0,00	500 000 EUR	Allianz SE, 4.597%, 07/09/38	565 918	0,01	
500 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.375%, 04/12/31	467 090	0,01	100 000 EUR	Allianz SE, 3.099%, 06/07/47	108 182	0,00	
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0.875%, 29/03/32	88 327	0,00	100 000 EUR	Allianz SE, 4.252%, 05/07/52	109 437	0,00	
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.375%, 25/05/33	90 846	0,00	100 000 EUR	Aroundtown SA, 1.500%, 28/05/26	98 535	0,00	
500 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 7.250%, perpetual	551 541	0,01	300 000 EUR	BASF SE, 0.875%, 22/05/25	321 493	0,01	
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.000%, 03/04/25	214 541	0,00	100 000 EUR	BASF SE, 0.750%, 17/03/26	104 952	0,00	
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 0.010%, 09/06/26	102 685	0,00	100 000 EUR	BASF SE, 0.250%, 05/06/27	101 172	0,00	
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 0.010%, 14/01/27	100 973	0,00	100 000 EUR	BASF SE, 3.125%, 29/06/28	111 783	0,00	
500 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.250%, 02/04/27	523 543	0,01	100 000 EUR	BASF SE, 1.500%, 17/03/31	99 501	0,00	
400 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.250%, 15/04/28	413 572	0,01	700 000 EUR	BASF SE, 4.250%, 08/03/32	823 687	0,01	
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.940%, 07/01/30	103 314	0,00	100 000 EUR	BASF SE, 3.750%, 29/06/32	114 400	0,00	
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.625%, 17/09/30	100 754	0,00	100 000 EUR	Bausparkasse Schwabebisch Hall AG, 0.200%, 28/10/31	91 176	0,00	
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 0.664%, 15/01/31	93 529	0,00	200 000 EUR	Bayerische Landesbank, 0.750%, 20/01/26	211 799	0,00	
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.250%, 14/05/35	89 969	0,00	100 000 GBP	Bayerische Landesbank, 5.125%, 01/06/26	129 229	0,00	
100 000 GBP	Vinci SA, 2.250%, 15/03/27	120 206	0,00	200 000 EUR	Bayerische Landesbank, 0.750%, 05/02/29	201 477	0,00	
400 000 EUR	Vinci SA, 0.010%, 27/11/28	387 882	0,01	100 000 EUR	Bayerische Landesbank, 0.125%, 02/11/29	95 668	0,00	
200 000 EUR	Vinci SA, 1.625%, 18/01/29	208 379	0,00	200 000 EUR	Bayerische Landesbank, 2.875%, 12/01/33	223 979	0,00	
100 000 EUR	Vivendi SE, 0.625%, 11/06/25	106 249	0,00	300 000 EUR	Bayerische Landesbodenkreditanstalt, 0.625%, 22/11/27	308 953	0,01	
300 000 EUR	Vivendi SE, 1.125%, 11/12/28	314 169	0,01	300 000 EUR	Berlin Hyp AG, 0.625%, 22/10/25	318 086	0,01	
100 000 EUR	Worldline SA, 0.875%, 30/06/27	99 743	0,00	100 000 EUR	Berlin Hyp AG, 0.375%, 25/01/27	101 802	0,00	
				100 000 EUR	Berlin Hyp AG, 1.125%, 25/10/27	101 123	0,00	
				400 000 EUR	Berlin Hyp AG, 0.010%, 24/01/28	398 385	0,01	
				300 000 EUR	Berlin Hyp AG, 0.375%, 21/04/31	261 514	0,01	
				500 000 EUR	Berlin Hyp AG, 3.000%, 10/01/33	565 647	0,01	
				200 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 2.000%, 01/04/28	211 996	0,00	
				100 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 1.500%, 15/05/30	99 646	0,00	
				100 000 EUR	Clearstream Banking AG, 0.010%, 01/12/25	104 562	0,00	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
100 000 EUR	Commerzbank AG, 0.625%, 28/05/25	106 673	0,00	60 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.125%, 29/05/51	41 832	0,00
455 000 EUR	Commerzbank AG, 0.100%, 11/09/25	476 364	0,01	100 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.125%, 17/03/25	107 054	0,00
500 000 EUR	Commerzbank AG, 2.875%, 28/04/26	553 988	0,01	300 000 EUR	Deutsche Bank AG, 0.500%, 22/01/26	315 879	0,01
100 000 EUR	Commerzbank AG, 1.125%, 22/06/26	104 691	0,00	100 000 EUR	Deutsche Bank AG, 2.625%, 12/02/26	108 377	0,00
100 000 EUR	Commerzbank AG, 0.875%, 22/01/27	102 644	0,00	650 000 USD	Deutsche Bank AG, 1.686%, 19/03/26	605 248	0,01
100 000 EUR	Commerzbank AG, 3.000%, 14/09/27	108 136	0,00	515 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.375%, 10/06/26	551 407	0,01
100 000 EUR	Commerzbank AG, 4.625%, 21/03/28	113 047	0,00	270 000 USD	Deutsche Bank AG, 2.129%, 24/11/26	253 090	0,00
23 000 EUR	Commerzbank AG, 1.500%, 28/08/28	24 246	0,00	500 000 EUR	Deutsche Bank AG, 3.000%, 18/01/27	557 014	0,01
500 000 EUR	Commerzbank AG, 2.875%, 13/10/28	557 036	0,01	300 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.625%, 20/01/27	311 402	0,01
300 000 EUR	Commerzbank AG, 5.125%, 18/01/30	346 802	0,01	1 000 000 USD	Deutsche Bank AG, 7.146%, 13/07/27	1 038 970	0,02
500 000 EUR	Commerzbank AG, 3.125%, 13/06/33	566 951	0,01	100 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.750%, 17/01/28	102 413	0,00
200 000 EUR	Commerzbank AG, 1.250%, 09/01/34	189 967	0,00	100 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.875%, 23/02/28	103 825	0,00
300 000 EUR	Commerzbank AG, 0.250%, perpetual	272 148	0,01	400 000 EUR	Deutsche Bank AG, 5.375%, 11/01/29	462 451	0,01
100 000 EUR	Continental AG, 3.625%, 30/11/27	112 241	0,00	1 000 000 USD	Deutsche Bank AG, 6.720%, 18/01/29	1 048 670	0,02
300 000 EUR	Continental AG, 4.000%, 01/06/28	341 976	0,01	200 000 EUR	Deutsche Bank AG, 0.125%, 21/01/30	189 788	0,00
200 000 EUR	Covestro AG, 0.875%, 03/02/26	211 728	0,00	100 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.750%, 19/11/30	95 997	0,00
300 000 EUR	Deutsche Apotheker-und Aerztebank eG, 0.050%, 13/11/29	285 215	0,01	100 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.375%, 17/02/32	90 737	0,00
100 000 GBP	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.375%, 07/07/25	121 643	0,00	500 000 USD	Deutsche Bank AG, 7.079%, 10/02/34	514 310	0,01
200 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.500%, 09/04/27	206 207	0,00	100 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 0.010%, 22/02/26	103 777	0,00
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.000%, 17/12/27	103 435	0,00	100 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 0.125%, 22/02/31	91 731	0,00
400 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.125%, 18/12/28	409 856	0,01	500 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.500%, 04/04/32	500 986	0,01
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.375%, 23/06/29	98 022	0,00	70 000 EUR	Deutsche Kreditbank AG, 0.010%, 23/02/26	71 732	0,00
400 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.875%, 24/05/30	417 098	0,01	100 000 EUR	Deutsche Kreditbank AG, 0.500%, 19/03/27	103 238	0,00
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.625%, 06/11/30	102 209	0,00	200 000 EUR	Deutsche Kreditbank AG, 0.010%, 07/11/29	189 998	0,00
200 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.625%, 16/08/33	196 294	0,00	100 000 EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.100%, 02/02/26	98 958	0,00
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 1.375%, 03/03/34	94 591	0,00	500 000 EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 3.625%, 13/10/26	561 416	0,01
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.750%, 16/07/35	84 947	0,00	200 000 EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.625%, 30/08/27	203 600	0,00
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.625%, 15/04/36	82 412	0,00	400 000 EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.100%, 21/01/28	394 837	0,01
100 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 0.875%, 23/06/39	79 657	0,00	100 000 EUR	Deutsche Post AG, 0.375%, 20/05/26	103 922	0,00
400 000 EUR	Deutsche Bahn Finance GMBH, 4.000%, 23/11/43	482 175	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
100 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.625%, 05/12/28	105 184	0,00	100 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 4.250%, 28/05/26	112 932	0,00
100 000 EUR	Deutsche Post AG, 0.750%, 20/05/29	100 945	0,00	135 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 0.375%, 28/09/26	138 614	0,00
100 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.000%, 20/05/32	98 266	0,00	100 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 0.750%, 15/01/28	100 762	0,00
200 000 EUR	Deutsche Post AG, 3.375%, 03/07/33	225 574	0,00	100 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 5.000%, 28/11/29	117 927	0,00
555 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 0.875%, 25/03/26	586 675	0,01	95 000 EUR	Fresenius SE & Co KGaA, 1.125%, 28/01/33	85 392	0,00
100 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 0.500%, 05/07/27	103 099	0,00	300 000 EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.375%, 09/03/26	304 502	0,01
50 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 1.750%, 25/03/31	51 890	0,00	100 000 EUR	Hamburg Commercial Bank AG, 0.100%, 02/11/28	97 299	0,00
100 000 GBP	Deutsche Telekom AG, 3.125%, 06/02/34	114 051	0,00	200 000 EUR	Hannover Rueck SE, 1.125%, 09/10/39	187 810	0,00
100 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 1.375%, 05/07/34	95 473	0,00	100 000 EUR	Hannover Rueck SE, 1.375%, 30/06/42	89 228	0,00
500 000 USD	Deutsche Telekom AG, 3.625%, 21/01/50	401 535	0,01	30 000 EUR	Heidelberg Materials AG, 1.500%, 07/02/25	32 520	0,00
400 000 EUR	Deutsche Wohnen SE, 1.500%, 30/04/30	386 230	0,01	500 000 EUR	Heidelberg Materials AG, 3.750%, 31/05/32	557 876	0,01
500 000 EUR	Dz Hyp AG, 0.010%, 26/10/26	511 784	0,01	100 000 GBP	Henkel AG & Co KGaA, 1.250%, 30/09/26	118 772	0,00
100 000 EUR	DZ HYP AG, 0.750%, 02/02/26	105 825	0,00	100 000 EUR	Infineon Technologies AG, 1.125%, 24/06/26	105 100	0,00
800 000 EUR	DZ HYP AG, 0.750%, 21/11/29	792 785	0,01	200 000 EUR	Infineon Technologies AG, 1.625%, 24/06/29	204 734	0,00
100 000 EUR	DZ HYP AG, 0.875%, 18/01/30	99 593	0,00	400 000 EUR	ING-DiBa AG, 0.010%, 07/10/28	390 485	0,01
700 000 EUR	DZ HYP AG, 3.000%, 30/11/32	789 679	0,01	500 000 EUR	ING-DiBa AG, 2.375%, 13/09/30	542 472	0,01
500 000 EUR	EON SE, 0.875%, 08/01/25	538 429	0,01	100 000 EUR	ING-DiBa AG, 1.000%, 23/05/39	83 267	0,00
55 000 EUR	EON SE, 0.125%, 18/01/26	57 251	0,00	500 000 EUR	Investitionsbank Berlin, 0.250%, 03/02/32	459 026	0,01
100 000 EUR	EON SE, 0.375%, 29/09/27	100 889	0,00	300 000 EUR	Investitionsbank Berlin, 0.050%, 02/03/35	247 234	0,00
100 000 EUR	EON SE, 3.500%, 12/01/28	113 037	0,00	200 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.625%, 15/01/25	215 407	0,00
100 000 EUR	EON SE, 0.750%, 20/02/28	102 333	0,00	750 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 18/02/25	800 750	0,01
100 000 EUR	EON SE, 0.100%, 19/12/28	98 641	0,00	1 000 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 4.125%, 27/03/25	992 890	0,02
607 000 EUR	EON SE, 3.750%, 01/03/29	693 817	0,01	600 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 31/03/25	638 976	0,01
30 000 EUR	EON SE, 0.350%, 28/02/30	28 129	0,00	700 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.375%, 23/04/25	748 341	0,01
50 000 EUR	EON SE, 1.625%, 29/03/31	49 872	0,00	200 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.000%, 02/05/25	193 268	0,00
70 000 EUR	EON SE, 0.875%, 20/08/31	65 893	0,00	800 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.125%, 30/06/25	849 573	0,01
100 000 EUR	EON SE, 0.600%, 01/10/32	89 793	0,00	100 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.125%, 04/07/25	121 242	0,00
131 000 EUR	EON SE, 4.000%, 29/08/33	152 257	0,00	625 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.375%, 18/07/25	586 750	0,01
40 000 EUR	EON SE, 0.875%, 18/10/34	35 560	0,00	500 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.875%, 02/09/25	632 970	0,01
40 000 EUR	EON SE, 3.875%, 12/01/35	45 930	0,00	200 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.250%, 15/09/25	212 197	0,00
500 000 EUR	Eurogrid GmbH, 3.722%, 27/04/30	563 333	0,01				
400 000 EUR	Eurogrid GmbH, 0.741%, 21/04/33	348 332	0,01				
100 000 EUR	Evonik Industries AG, 0.625%, 18/09/25	105 518	0,00				
400 000 EUR	Evonik Industries AG, 2.250%, 25/09/27	427 301	0,01				
100 000 EUR	FMS Wertmanagement, 0.375%, 29/04/30	96 861	0,00				
100 000 EUR	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, 1.500%, 11/07/25	106 634	0,00				
50 000 EUR	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, 0.625%, 30/11/26	50 539	0,00				
300 000 EUR	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, 3.875%, 20/09/27	337 002	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
225 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.625%, 22/01/26	208 978	0,00	200 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.750%, 15/01/29	203 580	0,00
200 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 4.125%, 18/02/26	254 453	0,00	600 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 15/06/29	581 532	0,01
200 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.375%, 09/03/26	211 143	0,00	200 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.750%, 14/09/29	177 910	0,00
1 000 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.625%, 01/04/26	987 560	0,02	1 000 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.000%, 15/11/29	1 079 078	0,02
800 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.875%, 29/05/26	891 196	0,01	500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.875%, 28/12/29	565 874	0,01
1 000 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 15/06/26	1 040 304	0,02	100 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.375%, 23/04/30	97 251	0,00
100 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.250%, 31/07/26	118 920	0,00	1 000 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.750%, 15/05/30	1 125 572	0,02
600 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.875%, 15/09/26	704 133	0,01	1 000 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.125%, 07/06/30	1 148 571	0,02
400 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 30/09/26	413 298	0,01	500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 17/09/30	468 858	0,01
800 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.000%, 01/10/26	736 248	0,01	400 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 10/01/31	371 949	0,01
200 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.125%, 30/12/26	228 426	0,00	500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.250%, 24/03/31	581 018	0,01
500 000 AUD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.000%, 15/02/27	319 991	0,01	800 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 15/09/31	731 888	0,01
200 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.625%, 22/02/27	209 130	0,00	500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.125%, 09/01/32	457 491	0,01
600 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 31/03/27	613 412	0,01	700 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.375%, 07/06/32	708 163	0,01
500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 30/04/27	510 243	0,01	250 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.125%, 15/09/32	246 456	0,00
1 000 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.000%, 20/05/27	966 420	0,02	800 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.750%, 14/02/33	898 902	0,01
500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.250%, 30/06/27	531 072	0,01	300 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.125%, 09/05/33	291 976	0,01
400 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.750%, 30/07/27	507 844	0,01	600 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.875%, 07/06/33	679 705	0,01
400 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.500%, 15/09/27	412 238	0,01	1 000 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 4.125%, 15/07/33	1 007 050	0,02
200 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.750%, 07/12/27	227 113	0,00	200 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.050%, 29/09/34	167 938	0,00
500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 15/12/27	502 859	0,01	100 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, zero coupon, 18/04/36	60 184	0,00
600 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.625%, 07/01/28	618 078	0,01	300 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.375%, 20/05/36	250 502	0,00
500 000 USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.750%, 15/02/28	495 365	0,01	100 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5.000%, 09/06/36	141 462	0,00
800 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.750%, 15/03/28	896 375	0,01	100 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.250%, 04/07/36	93 068	0,00
500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.750%, 28/06/28	513 817	0,01	200 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.125%, 31/03/37	181 600	0,00
600 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 15/09/28	592 892	0,01	150 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.125%, 15/06/37	135 289	0,00
1 000 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 3.125%, 10/10/28	1 140 706	0,02	100 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.875%, 04/07/39	83 945	0,00
500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, 09/11/28	491 934	0,01	500 000 EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.010%, perpetual	510 464	0,01
30 000 GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6.000%, 07/12/28	42 096	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
100 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.375%, 29/07/26	101 562	0,00	200 000 AUD	Landwirtschaftliche Rentenbank, 2.600%, 23/03/27	130 166	0,00
100 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.375%, 18/02/27	100 118	0,00	400 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.010%, 22/09/27	403 940	0,01
300 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.010%, 16/07/27	302 318	0,01	500 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.375%, 14/02/28	508 487	0,01
200 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 3.250%, 27/09/27	225 821	0,00	500 000 USD	Landwirtschaftliche Rentenbank, 3.875%, 14/06/28	497 895	0,01
500 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 1.750%, 28/02/28	533 894	0,01	200 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.010%, 19/07/28	198 203	0,00
100 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.375%, 07/05/29	92 485	0,00	200 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.500%, 28/02/29	200 432	0,00
200 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.375%, 21/02/31	173 894	0,00	400 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.050%, 18/12/29	383 610	0,01
200 000 EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 3.250%, 27/06/33	229 986	0,00	200 000 USD	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.875%, 03/09/30	163 238	0,00
400 000 EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 0.375%, 12/05/25	423 669	0,01	500 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 3.250%, 06/09/30	578 301	0,01
400 000 EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 0.500%, 16/01/26	421 601	0,01	300 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.050%, 31/01/31	278 829	0,01
400 000 EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 2.375%, 21/09/26	438 073	0,01	800 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 3.000%, 14/11/34	911 655	0,01
300 000 EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 0.875%, 20/03/28	308 360	0,01	100 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.625%, 31/10/36	85 202	0,00
500 000 USD	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 0.500%, 08/12/25	463 640	0,01	100 000 EUR	LEG Immobilien SE, 0.875%, 17/01/29	96 542	0,00
1 000 000 USD	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 4.875%, 09/03/26	1 009 750	0,02	100 000 EUR	LEG Immobilien SE, 0.750%, 30/06/31	87 598	0,00
500 000 EUR	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 2.750%, 16/02/28	558 080	0,01	300 000 EUR	LEG Immobilien SE, 0.875%, 30/03/33	250 094	0,00
1 000 000 USD	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank, 1.375%, 12/10/28	882 970	0,01	100 000 EUR	LEG Immobilien SE, 1.500%, 17/01/34	86 669	0,00
100 000 USD	Landwirtschaftliche Rentenbank, 2.000%, 13/01/25	97 198	0,00	100 000 EUR	LEG Immobilien SE, 1.625%, 28/11/34	84 167	0,00
500 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.500%, 06/03/25	536 727	0,01	65 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.750%, 08/02/30	62 947	0,00
300 000 USD	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.500%, 27/05/25	283 299	0,01	50 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.375%, 22/05/30	53 282	0,00
100 000 USD	Landwirtschaftliche Rentenbank, 2.375%, 10/06/25	96 883	0,00	90 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.750%, 10/09/30	86 248	0,00
200 000 GBP	Landwirtschaftliche Rentenbank, 1.375%, 08/09/25	242 628	0,00	100 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.125%, 06/11/31	96 662	0,00
100 000 EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.375%, 16/03/26	105 239	0,00	55 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.750%, 11/03/33	50 133	0,00
250 000 USD	Landwirtschaftliche Rentenbank, 1.750%, 27/07/26	235 328	0,00	100 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.125%, 08/08/34	91 422	0,00
				400 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.625%, 07/04/25	437 658	0,01
				100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.500%, 09/03/26	106 805	0,00
				400 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.000%, 22/08/26	432 669	0,01
				100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.375%, 08/11/26	103 133	0,00
				500 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.500%, 16/07/28	496 634	0,01
				200 000 EUR	Merck KGaA, 1.625%, 09/09/80	204 972	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
100 000 EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.500%, 22/04/26	104 936	0,00	100 000 EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.375%, 13/09/27	113 847	0,00
100 000 EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.625%, 23/10/26	104 322	0,00	100 000 EUR	SAP SE, 1.000%, 01/04/25	108 166	0,00
500 000 EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 3.000%, 04/08/27	559 704	0,01	300 000 EUR	SAP SE, 0.375%, 18/05/29	294 806	0,01
100 000 EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 2.500%, 04/07/28	109 884	0,00	100 000 EUR	SAP SE, 1.375%, 13/03/30	102 256	0,00
100 000 EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.375%, 09/03/29	93 731	0,00	300 000 EUR	SAP SE, 1.625%, 10/03/31	309 149	0,01
500 000 EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 1.875%, 25/08/32	517 970	0,01	500 000 EUR	UniCredit Bank AG, 0.010%, 28/09/26	512 734	0,01
100 000 EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.010%, perpetual	67 236	0,00	800 000 EUR	UniCredit Bank AG, 1.375%, 07/06/27	845 455	0,01
100 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 1.250%, 26/05/41	91 559	0,00	300 000 EUR	UniCredit Bank AG, 0.010%, 19/11/27	299 445	0,01
100 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 1.000%, 26/05/42	87 091	0,00	400 000 EUR	UniCredit Bank AG, 0.010%, 10/03/31	365 343	0,01
200 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3.250%, 26/05/49	213 942	0,00	100 000 EUR	UniCredit Bank AG, 0.250%, 15/01/32	90 922	0,00
300 000 EUR	Norddeutsche Landesbank-Girozentrale, 0.010%, 23/09/26	307 999	0,01	100 000 EUR	Vier Gas Transport GmbH, 2.875%, 12/06/25	110 009	0,00
300 000 EUR	Norddeutsche Landesbank-Girozentrale, 0.010%, 18/02/27	305 049	0,01	100 000 EUR	Vier Gas Transport GmbH, 4.000%, 26/09/27	113 556	0,00
100 000 EUR	Norddeutsche Landesbank-Girozentrale, 0.750%, 18/01/28	102 524	0,00	200 000 EUR	Vier Gas Transport GmbH, 0.125%, 10/09/29	188 875	0,00
100 000 EUR	Norddeutsche Landesbank-Girozentrale, 4.875%, 11/07/28	117 552	0,00	65 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 1.250%, 15/12/25	68 990	0,00
100 000 EUR	NRW Bank, 0.250%, 10/03/25	106 737	0,00	100 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 2.500%, 31/07/26	107 625	0,00
500 000 USD	NRW Bank, 4.500%, 09/06/25	497 960	0,01	500 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 4.375%, perpetual	569 497	0,01
500 000 USD	NRW Bank, 4.625%, 04/11/25	500 405	0,01	300 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.250%, 31/01/25	319 568	0,01
200 000 EUR	NRW Bank, 0.875%, 10/11/25	213 387	0,00	40 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.010%, 12/02/25	42 433	0,00
500 000 USD	NRW Bank, 0.875%, 09/03/26	463 550	0,01	300 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 3.000%, 06/04/25	329 367	0,01
700 000 EUR	NRW Bank, 0.250%, 16/03/27	719 924	0,01	65 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.125%, 12/02/27	65 196	0,00
200 000 EUR	NRW Bank, 0.500%, 13/09/27	205 456	0,00	200 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 2.250%, 01/10/27	215 117	0,00
300 000 EUR	NRW Bank, 0.625%, 04/01/28	308 075	0,01	470 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.875%, 31/01/28	469 774	0,01
100 000 EUR	NRW Bank, 3.000%, 31/05/30	113 612	0,00	100 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.375%, 12/02/30	91 264	0,00
200 000 EUR	NRW Bank, 0.010%, 03/02/31	184 441	0,00	50 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.625%, 15/08/25	53 641	0,00
500 000 EUR	NRW Bank, 2.500%, 07/09/37	526 758	0,01	55 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.250%, 12/01/26	56 967	0,00
400 000 EUR	NRW Bank, 0.500%, perpetual	292 242	0,01	200 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.500%, 19/06/26	211 379	0,00
200 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 3.625%, perpetual	225 634	0,00	100 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.375%, 20/07/26	102 426	0,00
100 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 4.000%, perpetual	117 054	0,00	35 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.500%, 12/01/29	33 531	0,00
500 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 4.375%, perpetual	592 639	0,01	500 000 EUR	Vonovia SE, 1.375%, 28/01/26	527 879	0,01
				100 000 EUR	Vonovia SE, 4.750%, 23/05/27	114 551	0,00
				100 000 EUR	Vonovia SE, 0.375%, 16/06/27	98 756	0,00
				100 000 EUR	Vonovia SE, 1.875%, 28/06/28	102 056	0,00
				200 000 EUR	Vonovia SE, 0.250%, 01/09/28	187 587	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Allemagne (suite)				Irlande (suite)			
100 000 EUR	Vonovia SE, 0.625%, 24/03/31	87 049	0,00	1 000 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 6.450%, 15/04/27	1 035 830	0,02
300 000 EUR	Vonovia SE, 1.000%, 16/06/33	251 658	0,00	100 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3.650%, 21/07/27	95 097	0,00
Allemagne – Total		101 291 894	1,52	500 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 5.750%, 06/06/28	512 270	0,01
Hong Kong				500 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3.000%, 29/10/28	456 030	0,01
200 000 USD	AIA Group Ltd, 3.600%, 09/04/29	189 472	0,00	150 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3.300%, 30/01/32	130 762	0,00
200 000 USD	AIA Group Ltd, 4.875%, 11/03/44	194 076	0,00	150 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3.400%, 29/10/33	129 023	0,00
100 000 USD	Beijing State-Owned Assets Management Hong Kong Co Ltd, 4.125%, 26/05/25	98 208	0,00	300 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3.850%, 29/10/41	243 219	0,01
300 000 USD	CITIC Ltd, 3.700%, 14/06/26	291 558	0,01	200 000 EUR	AIB Group PLC, 2.250%, 03/07/25	217 095	0,00
100 000 USD	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 4.125%, 19/07/27	96 736	0,00	500 000 EUR	AIB Group PLC, 3.625%, 04/07/26	552 347	0,01
300 000 USD	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 5.125%, 14/03/28	299 853	0,01	100 000 EUR	AIB Group PLC, 0.500%, 17/11/27	101 360	0,00
300 000 USD	Far East Horizon Ltd, 3.375%, 18/02/25	285 135	0,00	500 000 USD	Bank of Ireland Group PLC, 6.253%, 16/09/26	505 335	0,01
300 000 USD	Hong Kong Sukuk 2017 Ltd, 3.132%, 28/02/27	291 375	0,00	500 000 USD	Bank of Ireland Group PLC, 2.029%, 30/09/27	456 890	0,01
500 000 USD	Yan Gang Ltd, 1.900%, 23/03/26	454 445	0,01	500 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 5.000%, 04/07/31	589 270	0,01
Hong-Kong – Total		2 200 858	0,03	400 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.010%, 06/09/25	417 902	0,01
Hongrie				100 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.875%, 06/05/33	89 244	0,00
300 000 USD	MOL Hungarian Oil & Gas PLC, 1.500%, 08/10/27	299 850	0,00	100 000 EUR	CRH Finance DAC, 1.375%, 18/10/28	102 176	0,00
Hongrie – Total		299 850	0,00	300 000 EUR	CRH SMW Finance DAC, 1.250%, 05/11/26	315 753	0,01
Inde				100 000 EUR	Dell Bank International DAC, 0.500%, 27/10/26	102 193	0,00
200 000 USD	Bharti Airtel Ltd, 4.375%, 10/06/25	197 382	0,00	100 000 EUR	Dell Bank International DAC, 4.500%, 18/10/27	115 077	0,00
100 000 USD	Hindustan Petroleum Corp Ltd, 4.000%, 12/07/27	96 561	0,00	100 000 EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.450%, 15/09/27	98 058	0,00
200 000 USD	REC Ltd, 3.500%, 12/12/24	196 220	0,00	100 000 EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.950%, 15/09/31	88 443	0,00
200 000 USD	REC Ltd, 3.875%, 07/07/27	191 668	0,00	300 000 EUR	Eaton Capital UnLtd Co, 0.128%, 08/03/26	311 011	0,01
300 000 USD	Reliance Industries Ltd, 3.667%, 30/11/27	286 833	0,01	200 000 EUR	ESB Finance DAC, 1.750%, 07/02/29	207 659	0,00
Inde – Total		968 664	0,01	100 000 EUR	ESB Finance DAC, 1.000%, 19/07/34	88 722	0,00
Indonésie				200 000 GBP	ESB Finance DAC, 1.875%, 21/07/35	192 732	0,00
100 000 USD	Pertamina Persero PT, 5.625%, 20/05/43	101 602	0,00	100 000 EUR	Fresenius Finance Ireland PLC, 0.010%, 01/10/25	104 020	0,00
200 000 USD	Pertamina Persero PT, 6.450%, 30/05/44	218 792	0,00	50 000 EUR	Fresenius Finance Ireland PLC, 2.125%, 01/02/27	53 431	0,00
Indonésie – Total		320 394	0,00				
Irlande							
100 000 EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 0.375%, 19/11/27	101 175	0,00				
150 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3.500%, 15/01/25	146 730	0,00				
500 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4.450%, 01/10/25	490 885	0,01				
300 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 1.750%, 30/01/26	278 883	0,01				
650 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2.450%, 29/10/26	602 140	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Irlande (suite)				Italie (suite)			
100 000 EUR	Fresenius Finance Ireland PLC, 0.500%, 01/10/28	97 880	0,00	100 000 EUR	A2A SpA, 0.625%, 15/07/31	88 964	0,00
100 000 EUR	Fresenius Finance Ireland PLC, 0.875%, 01/10/31	89 305	0,00	100 000 EUR	A2A SpA, 1.000%, 02/11/33	84 930	0,00
100 000 GBP	Freshwater Finance PLC, 5.182%, 20/04/35	125 377	0,00	100 000 EUR	ACEA SpA, 0.010%, 28/09/25	104 124	0,00
100 000 EUR	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 0.375%, 15/09/27	99 712	0,00	200 000 EUR	ACEA SpA, 1.500%, 08/06/27	208 651	0,01
100 000 USD	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 1.750%, 15/09/30	83 084	0,00	200 000 EUR	ACEA SpA, 0.250%, 28/07/30	181 454	0,00
145 000 USD	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 2.000%, 16/09/31	120 688	0,00	100 000 EUR	Alperia SpA, 5.701%, 05/07/28	113 418	0,00
100 000 EUR	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 1.000%, 15/09/32	92 055	0,00	200 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.124%, 01/10/30	194 631	0,00
100 000 EUR	Kerry Group Financial Services Unltd Co, 0.625%, 20/09/29	97 362	0,00	200 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 1.713%, 30/06/32	177 919	0,00
400 000 EUR	Kerry Group Financial Services Unltd Co, 0.875%, 01/12/31	374 613	0,01	500 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.800%, 06/07/32	595 716	0,01
100 000 EUR	Linde PLC, 1.000%, 31/03/27	104 414	0,00	100 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.500%, 27/10/47	114 764	0,00
100 000 EUR	Linde PLC, 3.375%, 12/06/29	113 488	0,00	200 000 EUR	ASTM SpA, 1.000%, 25/11/26	205 940	0,00
100 000 EUR	Linde PLC, 1.375%, 31/03/31	99 590	0,00	100 000 EUR	ASTM SpA, 1.625%, 08/02/28	103 611	0,00
200 000 EUR	Linde PLC, 3.625%, 12/06/34	231 307	0,00	200 000 EUR	Banco BPM SpA, 1.000%, 23/01/25	214 954	0,01
100 000 EUR	Linde PLC, 1.625%, 31/03/35	94 841	0,00	100 000 EUR	BPER Banca, 0.625%, 28/10/28	98 539	0,00
200 000 EUR	Lunar Funding V for Swisscom AG, 1.125%, 12/10/26	210 204	0,00	300 000 EUR	Credit Agricole Italia SpA, 0.250%, 17/01/28	297 348	0,01
200 000 EUR	Ryanair DAC, 0.875%, 25/05/26	208 567	0,00	200 000 EUR	Credit Agricole Italia SpA, 1.625%, 21/03/29	206 773	0,00
90 000 USD	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC, 3.200%, 23/09/26	86 629	0,00	500 000 EUR	Credit Agricole Italia SpA, 3.500%, 15/01/30	563 631	0,01
300 000 EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.500%, 15/09/27	311 177	0,01	50 000 EUR	Enel SpA, 5.625%, 21/06/27	59 544	0,00
700 000 EUR	Vodafone International Financing DAC, 3.250%, perpetual	782 936	0,01	100 000 EUR	Enel SpA, 1.375%, perpetual	96 450	0,00
200 000 USD	Willow No 2 Ireland PLC for Zurich Insurance Co Ltd, 4.250%, 01/10/45	192 312	0,00	100 000 EUR	Enel SpA, 1.875%, perpetual	87 445	0,00
100 000 EUR	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 1.875%, 17/09/50	96 145	0,00	100 000 EUR	Eni SpA, 1.000%, 14/03/25	107 242	0,00
300 000 USD	Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 3.000%, 19/04/51	242 082	0,01	300 000 EUR	Eni SpA, 1.500%, 02/02/26	318 918	0,01
Irlande – Total		12 884 530	0,19	300 000 EUR	Eni SpA, 1.250%, 18/05/26	317 659	0,01
Israël				500 000 EUR	Eni SpA, 3.625%, 19/05/27	560 814	0,01
300 000 USD	ICL Group Ltd, 6.375%, 31/05/38	285 984	0,00	300 000 EUR	Eni SpA, 0.375%, 14/06/28	295 024	0,01
Israël – Total		285 984	0,00	200 000 USD	Eni SpA, 4.250%, 09/05/29	194 648	0,00
Italie				100 000 EUR	Eni SpA, 0.625%, 23/01/30	95 115	0,00
100 000 EUR	2i Rete Gas SpA, 2.195%, 11/09/25	108 265	0,00	100 000 EUR	Eni SpA, 1.000%, 11/10/34	85 583	0,00
100 000 EUR	2i Rete Gas SpA, 1.608%, 31/10/27	103 824	0,00	200 000 EUR	Eni SpA, 2.750%, perpetual	189 861	0,00
100 000 EUR	2i Rete Gas SpA, 4.375%, 06/06/33	113 094	0,00	100 000 EUR	ERG SpA, 0.500%, 11/09/27	99 772	0,00
100 000 EUR	A2A SpA, 1.500%, 16/03/28	103 448	0,00	400 000 EUR	ERG SpA, 0.875%, 15/09/31	354 805	0,01
200 000 EUR	A2A SpA, 1.000%, 16/07/29	195 216	0,00	200 000 EUR	Ferrovie dello Stato Italiane SpA, 1.500%, 27/06/25	214 607	0,01
				400 000 EUR	Ferrovie dello Stato Italiane SpA, 3.750%, 14/04/27	446 031	0,01
				200 000 EUR	Hera SpA, 0.875%, 14/10/26	207 619	0,00
				500 000 EUR	Hera SpA, 2.500%, 25/05/29	531 784	0,01
				100 000 EUR	Hera SpA, 1.000%, 25/04/34	86 069	0,00
				200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.250%, 07/02/25	215 584	0,01
				300 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 2.125%, 26/05/25	324 777	0,01
				200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.125%, 14/07/25	213 991	0,01
				800 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.000%, 25/09/25	852 030	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				
Italie (suite)				Italie (suite)				
100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 3.250%, 10/02/26	110 810	0,00	200 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.375%, 26/07/27	208 213	0,00	
100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.000%, 19/11/26	103 552	0,00	500 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.375%, 23/06/29	476 877	0,01	
169 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.375%, 29/08/27	191 592	0,00	100 000 EUR	Unicredit SpA, 1.625%, 18/01/32	94 434	0,00	
100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.125%, 04/10/27	103 542	0,00	100 000 EUR	UniCredit SpA, 0.325%, 19/01/26	104 015	0,00	
500 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.000%, 08/03/28	571 402	0,01	400 000 EUR	UniCredit SpA, 1.200%, 20/01/26	428 878	0,01	
100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.750%, 16/03/28	99 505	0,00	200 000 EUR	UniCredit SpA, 0.375%, 31/10/26	205 856	0,00	
100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.750%, 04/07/29	100 635	0,00	150 000 EUR	UniCredit SpA, 5.850%, 15/11/27	175 545	0,00	
100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.250%, 13/01/30	118 501	0,00	100 000 EUR	UniCredit SpA, 0.925%, 18/01/28	102 571	0,00	
200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.125%, 29/08/31	235 763	0,01	700 000 EUR	UniCredit SpA, 4.800%, 17/01/29	809 304	0,01	
100 000 GBP	Intesa Sanpaolo SpA, 6.625%, 31/05/33	134 641	0,00	200 000 EUR	UniCredit SpA, 0.800%, 05/07/29	196 433	0,00	
500 000 USD	Intesa Sanpaolo SpA, 7.800%, 28/11/53	551 460	0,01	500 000 EUR	UniCredit SpA, 3.500%, 31/07/30	565 382	0,01	
500 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.875%, perpetual	580 930	0,01	100 000 EUR	UniCredit SpA, 0.850%, 19/01/31	91 074	0,00	
100 000 EUR	Iren SpA, 1.950%, 19/09/25	107 956	0,00	Italie – Total			19 487 628	0,29
100 000 EUR	Iren SpA, 1.500%, 24/10/27	104 294	0,00	Côte-d'Ivoire				
100 000 EUR	Iren SpA, 1.000%, 01/07/30	94 153	0,00	500 000 EUR	African Development Bank, 2.250%, 14/09/29	545 233	0,01	
100 000 EUR	Italgas SpA, 0.250%, 24/06/25	105 338	0,00	Côte-d'Ivoire – Total			545 233	0,01
300 000 EUR	Italgas SpA, 0.010%, 16/02/28	293 116	0,01	Japon				
100 000 EUR	Italgas SpA, 1.000%, 11/12/31	91 789	0,00	500 000 USD	Aozora Bank Ltd, 5.900%, 02/03/26	505 785	0,01	
100 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.625%, 07/01/25	107 934	0,00	100 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 1.151%, 19/09/25	106 485	0,00	
100 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.375%, 10/11/25	106 988	0,00	100 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 0.336%, 19/04/27	100 631	0,00	
100 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.875%, 15/01/26	105 096	0,00	100 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 0.541%, 23/10/28	97 516	0,00	
500 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 4.750%, 14/03/28	570 784	0,01	100 000 EUR	East Japan Railway Co, 2.614%, 08/09/25	109 196	0,00	
100 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.000%, 17/07/29	98 591	0,00	100 000 EUR	East Japan Railway Co, 3.245%, 08/09/30	111 783	0,00	
100 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.250%, 24/11/29	100 295	0,00	200 000 EUR	East Japan Railway Co, 3.976%, 05/09/32	235 167	0,00	
400 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.010%, 03/02/31	356 356	0,01	100 000 EUR	East Japan Railway Co, 1.850%, 13/04/33	98 842	0,00	
100 000 EUR	Snam SpA, 0.010%, 15/08/25	104 779	0,00	100 000 GBP	East Japan Railway Co, 5.250%, 22/04/33	135 483	0,00	
100 000 EUR	Snam SpA, 1.375%, 25/10/27	104 124	0,00	100 000 EUR	East Japan Railway Co, 0.773%, 15/09/34	86 830	0,00	
100 000 EUR	Snam SpA, 0.750%, 17/06/30	93 786	0,00	100 000 EUR	East Japan Railway Co, 1.104%, 15/09/39	79 644	0,00	
300 000 EUR	Snam SpA, 0.625%, 30/06/31	271 880	0,01	200 000 EUR	East Japan Railway Co, 4.389%, 05/09/43	240 058	0,00	
100 000 EUR	Snam SpA, 1.250%, 20/06/34	89 376	0,00	500 000 USD	Honda Motor Co Ltd, 2.534%, 10/03/27	471 490	0,01	
100 000 EUR	Snam SpA, 1.000%, 12/09/34	85 492	0,00	500 000 USD	Honda Motor Co Ltd, 2.967%, 10/03/32	457 675	0,01	
				1 000 000 USD	JERA CO INC, 3.665%, perpetual	955 800	0,01	
				200 000 EUR	Mitsubishi ufj Financial Group Inc, 3.556%, perpetual	225 945	0,00	
				400 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2.193%, 25/02/25	386 424	0,01	
				500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 1.412%, 17/07/25	472 225	0,01	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 5.719%, 20/02/26	502 105	0,01	500 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 2.201%, 10/07/31	417 205	0,01
200 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3.850%, 01/03/26	195 348	0,00	100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 2.096%, 08/04/32	99 061	0,00
500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 5.541%, 17/04/26	501 300	0,01	100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.843%, 12/04/33	89 224	0,00
100 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2.757%, 13/09/26	94 489	0,00	100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.416%, 20/05/33	116 207	0,00
500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 1.538%, 20/07/27	457 060	0,01	200 000 USD	Nippon Life Insurance Co, 4.700%, 20/01/46	195 524	0,00
100 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3.287%, 25/07/27	95 446	0,00	200 000 USD	Nippon Life Insurance Co, 4.000%, 19/09/47	188 572	0,00
500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 1.640%, 13/10/27	455 470	0,01	300 000 USD	Nippon Life Insurance Co, 2.750%, 21/01/51	249 012	0,00
200 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3.961%, 02/03/28	194 964	0,00	300 000 USD	Nomura Holdings Inc, 2.648%, 16/01/25	291 045	0,00
500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 5.422%, 22/02/29	509 390	0,01	500 000 USD	Nomura Holdings Inc, 1.851%, 16/07/25	473 065	0,01
500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 5.242%, 19/04/29	506 870	0,01	500 000 USD	Nomura Holdings Inc, 1.653%, 14/07/26	457 080	0,01
500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2.048%, 17/07/30	419 825	0,01	1 000 000 USD	Nomura Holdings Inc, 5.842%, 18/01/28	1 022 100	0,02
200 000 EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4.636%, 07/06/31	233 256	0,00	500 000 USD	Nomura Holdings Inc, 2.679%, 16/07/30	426 520	0,01
500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2.309%, 20/07/32	415 605	0,01	1 000 000 USD	Nomura Holdings Inc, 6.087%, 12/07/33	1 060 330	0,02
500 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4.315%, 19/04/33	478 140	0,01	500 000 USD	Norinchukin Bank, 1.284%, 22/09/26	452 740	0,01
1 000 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 5.441%, 22/02/34	1 034 040	0,02	200 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.010%, 03/03/25	212 049	0,00
335 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4.286%, 26/07/38	316 036	0,01	500 000 USD	NTT Finance Corp, 1.162%, 03/04/26	461 720	0,01
300 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.214%, 07/10/25	314 520	0,01	200 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.399%, 13/12/28	196 243	0,00
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.184%, 13/04/26	103 024	0,00	500 000 USD	Olympus Corp, 2.143%, 08/12/26	460 550	0,01
500 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 2.651%, 22/05/26	480 625	0,01	50 000 USD	ORIX Corp, 3.700%, 18/07/27	48 166	0,00
200 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 2.226%, 25/05/26	191 210	0,00	200 000 USD	Sumitomo Life Insurance Co, 4.000%, 14/09/77	188 352	0,00
100 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 2.839%, 13/09/26	94 630	0,00	300 000 EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp, 0.409%, 07/11/29	282 746	0,00
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 1.631%, 08/04/27	104 592	0,00	300 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.348%, 15/01/25	291 177	0,00
200 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 4.018%, 05/03/28	194 292	0,00	200 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1.474%, 08/07/25	189 304	0,00
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.157%, 20/05/28	113 354	0,00	100 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.784%, 09/03/26	97 553	0,00
500 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 5.667%, 27/05/29	512 295	0,01	200 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.632%, 14/07/26	189 552	0,00
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.470%, 06/09/29	95 403	0,00	500 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1.402%, 17/09/26	455 630	0,01
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.797%, 15/04/30	93 700	0,00	100 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.010%, 19/10/26	95 145	0,00
200 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.608%, 28/08/30	234 049	0,00	300 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.446%, 11/01/27	288 483	0,00
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.693%, 07/10/30	91 991	0,00	50 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.352%, 18/10/27	47 394	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Japon (suite)				Jersey (suite)			
1 000 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 5.520%, 13/01/28	1 023 800	0,02	100 000 GBP	CPUK Finance Ltd, 3.588%, 28/08/25	123 342	0,00
1 000 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 5.800%, 13/07/28	1 036 290	0,02	254 832 USD	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2.160%, 31/03/34	221 770	0,00
200 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.040%, 16/07/29	182 068	0,00	100 000 GBP	Gatwick Funding Ltd, 6.125%, 02/03/26	130 330	0,00
100 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0.632%, 23/10/29	94 513	0,00	100 000 GBP	Gatwick Funding Ltd, 2.500%, 15/04/30	112 045	0,00
200 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 4.492%, 12/06/30	232 946	0,00	75 000 GBP	Heathrow Funding Ltd, 6.750%, 03/12/26	100 517	0,00
200 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.130%, 08/07/30	168 524	0,00	200 000 GBP	Heathrow Funding Ltd, 2.625%, 16/03/28	226 695	0,01
200 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.142%, 23/09/30	166 370	0,00	300 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 1.125%, 08/10/30	283 489	0,01
200 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.222%, 17/09/31	165 338	0,00	100 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 1.875%, 12/07/32	96 637	0,00
500 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 5.808%, 14/09/33	533 480	0,01	100 000 EUR	Heathrow Funding Ltd, 1.875%, 14/03/34	93 069	0,00
300 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.930%, 17/09/41	225 165	0,00	200 000 GBP	Heathrow Funding Ltd, 2.750%, 09/08/49	168 641	0,00
500 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.050%, 14/01/42	388 225	0,01	Jersey – Total		3 374 032	0,05
1 000 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 6.184%, 13/07/43	1 115 070	0,02	Kazakhstan			
500 000 USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 5.650%, 09/03/26	506 630	0,01	300 000 USD	KazMunayGas National Co JSC, 6.375%, 24/10/48	282 684	0,00
100 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 2.250%, 21/11/26	107 926	0,00	Kazakhstan – Total			
250 000 USD	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 5.000%, 26/11/28	253 957	0,00	Corée			
300 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 1.000%, 09/07/29	295 290	0,00	1 000 000 USD	Doosan Enerbility Co Ltd, 5.500%, 17/07/26	1 012 720	0,01
400 000 USD	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 2.050%, 31/03/30	343 332	0,01	500 000 USD	Kookmin Bank, 4.625%, 21/04/28	498 290	0,01
100 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 3.000%, 21/11/30	108 953	0,00	100 000 EUR	Kookmin Bank, 0.048%, perpetual	101 609	0,00
500 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 2.000%, 09/07/40	438 204	0,01	1 000 000 USD	Mirae Asset Securities Co Ltd, 6.875%, 26/07/26	1 021 160	0,01
600 000 USD	Toyota Motor Corp, 1.339%, 25/03/26	559 542	0,01	500 000 USD	NongHyup Bank, 1.250%, 20/07/25	471 785	0,01
1 000 000 USD	Toyota Motor Corp, 5.275%, 13/07/26	1 018 110	0,02	500 000 USD	Shinhan Bank Co Ltd, 4.500%, 12/04/28	495 760	0,01
100 000 USD	Toyota Motor Corp, 3.669%, 20/07/28	97 881	0,00	500 000 USD	SK Hynix Inc, 1.500%, 19/01/26	460 635	0,01
600 000 USD	Toyota Motor Corp, 2.362%, 25/03/31	527 508	0,01	Corée – Total		4 061 959	0,06
1 000 000 USD	Toyota Motor Corp, 5.123%, 13/07/33	1 079 050	0,02	Liechtenstein			
Japon – Total				Swiss Life Finance I Ltd, 0.500%, 15/09/31			
33 619 929				89 578			
0,50				89 578			
0,50				0,00			
Jersey				Lituanie			
100 000 GBP	AA Bond Co Ltd, 5.500%, 31/07/27	121 120	0,00	2 000 000 USD	Bacardi Ltd / Bacardi-Martini BV, 5.900%, 15/06/43	2 028 520	0,03
200 000 EUR	Aptiv PLC, 1.500%, 10/03/25	215 139	0,00	1 000 000 USD	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc, 5.500%, 15/01/30	982 350	0,01
200 000 USD	Aptiv PLC, 5.400%, 15/03/49	186 938	0,00	200 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC, 5.350%, 01/03/26	200 984	0,00
500 000 USD	Aptiv PLC, 3.100%, 01/12/51	327 200	0,01	40 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2.700%, 01/05/25	38 546	0,00
1 000 000 USD	Aptiv PLC / Aptiv Corp, 2.396%, 18/02/25	967 100	0,02	65 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3.150%, 01/05/27	61 769	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Lituanie (suite)				Luxembourg (suite)			
40 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 4.400%, 01/06/27	39 535	0,00	30 000 USD	DH Europe Finance II Sarl, 2.600%, 15/11/29	27 170	0,00
85 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3.400%, 01/05/30	78 189	0,00	100 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.750%, 18/09/31	93 105	0,00
600 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2.500%, 11/05/31	510 006	0,01	100 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.350%, 18/09/39	83 439	0,00
500 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2.650%, 15/02/32	422 020	0,01	350 000 USD	DH Europe Finance II Sarl, 3.250%, 15/11/39	290 913	0,01
50 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 5.000%, 15/01/33	49 989	0,00	100 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.800%, 18/09/49	80 267	0,00
560 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3.250%, 11/05/41	427 745	0,01	350 000 USD	DH Europe Finance II Sarl, 3.400%, 15/11/49	277 154	0,01
Lituanie – Total		4 839 653	0,07	100 000 EUR	DH Europe Finance Sarl, 1.200%, 30/06/27	104 292	0,00
Luxembourg				500 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.400%, 17/02/25	536 645	0,01
500 000 USD	Arcelormittal SA, 6.550%, 29/11/27	525 260	0,01	200 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.200%, 28/04/25	213 253	0,00
300 000 USD	ArcelorMittal SA, 6.750%, 01/03/41	318 147	0,01	1 000 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.010%, 15/10/25	1 054 587	0,02
100 000 EUR	Aroundtown SA, 0.625%, 09/07/25	102 112	0,00	200 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.400%, 26/01/26	211 490	0,00
100 000 EUR	Aroundtown SA, 0.010%, 16/07/26	92 730	0,00	100 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.400%, 31/05/26	105 228	0,00
100 000 EUR	Aroundtown SA, 1.450%, 09/07/28	86 090	0,00	1 000 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.010%, 20/07/26	1 037 255	0,02
300 000 GBP	Aroundtown SA, 3.625%, 10/04/31	266 721	0,01	500 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.625%, 16/10/26	525 261	0,01
500 000 EUR	Aroundtown SA, 1.625%, perpetual	178 246	0,00	200 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.750%, 03/05/27	209 539	0,00
100 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.208%, 04/06/26	105 449	0,00	200 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.875%, 26/07/27	209 722	0,00
200 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 0.334%, 13/08/28	194 547	0,00	1 100 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.010%, 13/10/27	1 109 971	0,02
500 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 3.553%, 13/09/29	563 819	0,01	600 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.950%, 14/02/28	624 912	0,01
100 000 EUR	Bevco Lux Sarl, 1.500%, 16/09/27	103 695	0,00	700 000 EUR	European Financial Stability Facility, 2.375%, 11/04/28	772 234	0,01
100 000 EUR	Bevco Lux Sarl, 1.000%, 16/01/30	92 301	0,00	1 000 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.875%, 05/09/28	1 029 678	0,02
100 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1.000%, 20/10/26	99 094	0,00	700 000 EUR	European Financial Stability Facility, 3.000%, 15/12/28	792 757	0,01
100 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1.250%, 26/04/27	97 029	0,00	400 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.050%, 17/10/29	385 001	0,01
400 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 3.625%, 29/10/29	406 352	0,01	100 000 EUR	European Financial Stability Facility, 2.750%, 03/12/29	112 188	0,00
100 000 GBP	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 4.875%, 29/04/32	113 216	0,00	1 200 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.010%, 20/01/31	1 111 221	0,02
200 000 EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.125%, 17/10/28	199 217	0,00	100 000 EUR	European Financial Stability Facility, 3.875%, 30/03/32	121 034	0,00
200 000 GBP	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 2.625%, 17/10/34	187 217	0,00	100 000 EUR	European Financial Stability Facility, 1.250%, 24/05/33	97 885	0,00
200 000 EUR	CPI Property Group SA, 1.625%, 23/04/27	161 842	0,00	150 000 EUR	European Financial Stability Facility, 3.000%, 04/09/34	169 724	0,00
500 000 EUR	CPI Property Group SA, 1.750%, 14/01/30	314 831	0,01	700 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.875%, 10/04/35	633 427	0,01
100 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.200%, 18/03/26	103 699	0,00	300 000 EUR	European Financial Stability Facility, 1.450%, 05/09/40	266 581	0,01
100 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.450%, 18/03/28	99 790	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Luxembourg (suite)				Luxembourg (suite)			
800 000 EUR	European Financial Stability Facility, 1.700%, 13/02/43	722 901	0,01	100 000 GBP	John Deere Bank SA, 5.125%, 18/10/28	133 024	0,00
100 000 EUR	European Financial Stability Facility, 2.350%, 29/07/44	99 950	0,00	300 000 EUR	John Deere Cash Management SARL, 2.200%, 02/04/32	312 840	0,01
200 000 EUR	European Financial Stability Facility, 1.200%, 17/02/45	160 590	0,00	100 000 EUR	Logicor Financing Sarl, 1.500%, 13/07/26	103 396	0,00
300 000 EUR	European Financial Stability Facility, 1.375%, 31/05/47	243 824	0,00	100 000 EUR	Logicor Financing Sarl, 1.625%, 15/07/27	101 521	0,00
300 000 EUR	European Financial Stability Facility, 1.800%, 10/07/48	261 623	0,01	200 000 GBP	Logicor Financing Sarl, 2.750%, 15/01/30	210 429	0,00
400 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.700%, 20/01/50	260 432	0,01	100 000 EUR	Logicor Financing Sarl, 1.625%, 17/01/30	94 454	0,00
200 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.050%, 18/01/52	98 000	0,00	100 000 EUR	Logicor Financing Sarl, 0.875%, 14/01/31	85 392	0,00
600 000 EUR	European Financial Stability Facility, 0.700%, 17/01/53	367 259	0,01	100 000 EUR	Logicor Financing Sarl, 2.000%, 17/01/34	86 474	0,00
300 000 EUR	European Financial Stability Facility, 1.750%, 17/07/53	248 165	0,00	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.125%, 07/03/27	104 417	0,00
200 000 EUR	European Financial Stability Facility, 2.000%, 28/02/56	173 576	0,00	400 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.375%, 15/10/28	393 052	0,01
600 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 28/03/28	599 825	0,01	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.000%, 15/10/28	110 758	0,00
600 000 EUR	European Investment Bank, 2.250%, 15/03/30	655 957	0,01	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.625%, 07/03/31	100 050	0,00
1 800 000 EUR	EUROPEAN INVESTMENT BANK, 0.375%, 15/09/27	1 849 463	0,03	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.000%, 02/07/31	95 488	0,00
700 000 EUR	EUROPEAN INVESTMENT BANK, 0.250%, 20/01/32	647 315	0,01	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.125%, 15/10/31	110 846	0,00
1 000 000 USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK, 2.750%, perpetual	973 390	0,02	300 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.750%, 15/10/32	273 023	0,01
900 000 EUR	European Stability Mechanism, 0.010%, perpetual	820 650	0,01	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.375%, 15/10/34	111 457	0,00
200 000 EUR	GELF Bond Issuer I SA, 1.125%, 18/07/29	187 406	0,00	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.500%, 02/07/39	84 236	0,00
100 000 EUR	Grand City Properties SA, 1.375%, 03/08/26	101 796	0,00	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.750%, 02/07/49	77 601	0,00
500 000 EUR	Grand City Properties SA, 0.125%, 11/01/28	463 506	0,01	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.010%, 14/06/26	103 624	0,00
100 000 EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.500%, 14/06/27	105 997	0,00	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.875%, 29/03/27	104 663	0,00
100 000 EUR	Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 1.750%, 24/04/28	105 356	0,00	250 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.125%, 12/11/27	251 670	0,00
100 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.375%, 09/04/25	109 020	0,00	71 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.500%, 13/12/27	80 999	0,00
100 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.500%, 29/11/26	102 956	0,00	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.250%, 14/06/29	97 688	0,00
100 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.125%, 19/07/27	100 145	0,00	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 1.250%, 02/11/29	102 094	0,00
100 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 2.250%, 26/05/28	107 074	0,00	500 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.250%, 15/01/31	568 403	0,01
400 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.500%, 03/09/30	366 876	0,01	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.375%, 12/05/32	91 171	0,00
100 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.625%, 19/01/33	86 253	0,00	100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 3.750%, 13/03/33	118 563	0,00
100 000 EUR	John Deere Bank SA, 2.500%, 14/09/26	109 243	0,00	75 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.625%, 14/02/34	66 923	0,00
				100 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 1.500%, 29/03/35	95 557	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				
Luxembourg (suite)				Malaisie				
100 000 GBP	Nestle Finance International Ltd, 5.125%, 07/12/38	135 507	0,00	200 000 USD	Malaysia Sovereign Sukuk Bhd, 3.043%, 22/04/25	196 120	0,00	
75 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 0.875%, 14/06/41	59 593	0,00	1 000 000 USD	Misc Capital Two Labuan Ltd, 3.625%, 06/04/25	978 720	0,02	
300 000 EUR	NORD/LB Luxembourg SA Covered Bond Bank, 0.050%, 28/01/25	319 127	0,01	200 000 USD	Petronas Capital Ltd, 3.500%, 18/03/25	196 516	0,00	
100 000 EUR	Novartis Finance SA, 1.125%, 30/09/27	105 418	0,00	300 000 USD	Petronas Capital Ltd, 3.500%, 21/04/30	281 622	0,00	
400 000 EUR	Novartis Finance SA, 0.010%, 23/09/28	390 922	0,01	500 000 USD	Petronas Capital Ltd, 2.480%, 28/01/32	427 885	0,01	
100 000 EUR	Novartis Finance SA, 1.375%, 14/08/30	101 495	0,00	100 000 USD	Petronas Capital Ltd, 4.500%, 18/03/45	91 873	0,00	
500 000 USD	Nvent Finance SArl, 2.750%, perpetual	410 915	0,01	500 000 USD	Petronas Capital Ltd, 3.404%, 28/04/61	359 400	0,01	
300 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 0.875%, 09/07/29	290 819	0,01	Malaisie – Total			2 532 136	0,04
400 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 4.625%, 21/02/35	460 131	0,01	Mexique				
400 000 EUR	Repsol Europe Finance Sarl, 0.375%, 06/07/29	382 249	0,01	200 000 USD	Alfa SAB de CV, 6.875%, 25/03/44	198 854	0,00	
100 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.000%, 26/03/26	105 905	0,00	100 000 GBP	America Movil SAB de CV, 5.000%, 27/10/26	129 016	0,00	
500 000 EUR	Richemont International Holding SA, 0.750%, 26/05/28	506 885	0,01	200 000 EUR	America Movil SAB de CV, 2.125%, 10/03/28	211 467	0,01	
100 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.500%, 26/03/30	102 169	0,00	200 000 USD	America Movil SAB de CV, 2.875%, 07/05/30	178 174	0,00	
100 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.125%, 26/05/32	95 709	0,00	100 000 GBP	America Movil SAB de CV, 4.948%, 22/07/33	130 703	0,00	
100 000 EUR	Richemont International Holding SA, 2.000%, 26/03/38	95 565	0,00	25 000 USD	America Movil SAB de CV, 6.375%, 01/03/35	27 916	0,00	
150 000 USD	Schlumberger Investment SA, 2.650%, 26/06/30	134 933	0,00	200 000 USD	America Movil SAB de CV, 6.125%, 30/03/40	217 800	0,01	
100 000 EUR	SELP Finance Sarl, 1.500%, 20/11/25	106 270	0,00	500 000 USD	Comision Federal de Electricidad, 4.677%, 09/02/51	351 075	0,01	
100 000 EUR	Ses SA, 2.000%, 02/07/28	104 009	0,00	200 000 USD	Mexico City Airport Trust, 5.500%, 31/07/47	171 700	0,00	
100 000 EUR	SES SA, 3.500%, 14/01/29	108 848	0,00	200 000 USD	Orbia Advance Corp SAB de CV, 5.875%, 17/09/44	179 510	0,00	
100 000 EUR	Swiss Re Finance Luxembourg SA, 2.534%, 30/04/50	102 325	0,00	Mexique – Total			1 796 215	0,03
500 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 4.250%, perpetual	567 934	0,01	Pays-Bas				
100 000 EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.010%, 14/02/25	106 271	0,00	500 000 EUR	ABB Finance BV, 0.010%, 19/01/30	465 107	0,01	
1 000 000 USD	Tyco Electronics Group SA, 4.500%, 13/02/26	996 740	0,02	200 000 GBP	ABN AMRO Bank NV, 1.375%, 16/01/25	244 915	0,01	
100 000 EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.010%, 16/02/29	95 459	0,00	100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.875%, 22/04/25	106 806	0,00	
500 000 USD	Tyco Electronics Group SA, 2.500%, perpetual	434 145	0,01	600 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.625%, 10/01/26	668 092	0,01	
100 000 EUR	Whirlpool EMEA Finance Sarl, 0.500%, 20/02/28	97 872	0,00	200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.875%, 14/01/26	212 400	0,01	
Luxembourg – Total			37 512 913	0,56	300 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.500%, 15/04/26	313 626	0,01
				200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.875%, 21/12/26	225 430	0,01	
				100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 2.375%, 01/06/27	107 520	0,00	
				100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.000%, 16/01/28	113 280	0,00	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.500%, 23/09/29	93 863	0,00	100 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.500%, 14/01/31	95 284	0,00
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.250%, 21/02/30	114 674	0,00	100 000 EUR	Allianz Finance II BV, 1.375%, 21/04/31	101 231	0,00
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.000%, 13/04/31	98 198	0,00	300 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.500%, 22/11/33	266 365	0,01
200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.125%, 12/01/32	195 452	0,00	100 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 0.750%, 08/03/25	106 790	0,00
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.000%, 01/06/32	107 774	0,00	100 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.375%, 08/03/28	103 386	0,00
300 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.250%, 10/01/33	290 431	0,01	100 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.625%, 08/03/31	99 822	0,00
300 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 5.500%, 21/09/33	346 742	0,01	100 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.875%, 08/03/34	96 096	0,00
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.375%, 12/01/37	90 989	0,00	200 000 EUR	Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co Ltd, 2.750%, 19/02/49	206 989	0,00
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.450%, 12/04/38	90 062	0,00	100 000 EUR	ASML Holding NV, 3.500%, 06/12/25	111 344	0,00
100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.125%, 23/04/39	83 334	0,00	200 000 EUR	ASML Holding NV, 0.625%, 07/05/29	197 706	0,00
200 000 USD	ABN AMRO BANK NV, 4.750%, 28/07/25	196 234	0,00	200 000 EUR	ASML Holding NV, 2.250%, 17/05/32	213 637	0,01
100 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 0.600%, 15/01/27	101 957	0,00	400 000 EUR	ASR Nederland NV, 7.000%, 07/12/43	497 976	0,01
1 000 000 USD	ABN AMRO BANK NV, 2.470%, 13/12/29	879 120	0,02	100 000 EUR	ASR Nederland NV, 5.125%, 29/09/45	111 627	0,00
100 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 1.250%, 20/01/34	89 414	0,00	100 000 EUR	BASF Finance Europe NV, 0.750%, 10/11/26	105 065	0,00
200 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 0.375%, 14/01/35	168 234	0,00	300 000 EUR	BAT Netherlands Finance BV, 3.125%, 07/04/28	330 616	0,01
500 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 1.375%, perpetual	480 849	0,01	100 000 EUR	BMW Finance NV, 1.000%, 29/08/25	106 774	0,00
400 000 EUR	Achmea Bank NV, 0.500%, 20/02/26	419 445	0,01	50 000 EUR	BMW Finance NV, 0.010%, 11/01/26	52 139	0,00
200 000 EUR	Achmea Bank NV, 0.250%, 29/09/36	157 035	0,00	100 000 EUR	BMW Finance NV, 1.125%, 22/05/26	105 897	0,00
300 000 EUR	Achmea BV, 3.625%, 29/11/25	332 807	0,01	70 000 EUR	BMW Finance NV, 0.750%, 13/07/26	73 274	0,00
100 000 EUR	Achmea BV, 4.250%, perpetual	109 403	0,00	100 000 EUR	BMW Finance NV, 0.375%, 14/01/27	103 082	0,00
400 000 EUR	Aegon Bank NV, 0.375%, 09/06/36	322 527	0,01	100 000 EUR	BMW Finance NV, 0.375%, 24/09/27	101 834	0,00
100 000 GBP	Aegon Ltd, 6.625%, 16/12/39	145 517	0,00	430 000 EUR	BMW Finance NV, 1.000%, 22/05/28	440 538	0,01
100 000 EUR	Akelius Residential Property Financing BV, 1.000%, 17/01/28	95 054	0,00	100 000 EUR	BMW Finance NV, 1.500%, 06/02/29	103 305	0,00
100 000 EUR	Akelius Residential Property Financing BV, 0.750%, 22/02/30	85 674	0,00	240 000 EUR	BMW Finance NV, 0.875%, 14/01/32	230 958	0,00
100 000 EUR	Alliander NV, 3.250%, 13/06/28	112 669	0,00	50 000 EUR	BMW Finance NV, 0.200%, 11/01/33	43 505	0,00
200 000 EUR	Alliander NV, 1.625%, perpetual	211 529	0,01	400 000 EUR	BMW Finance NV, 3.250%, perpetual	445 691	0,01
100 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.875%, 15/01/26	106 178	0,00	300 000 AUD	BNG Bank NV, 3.500%, 19/07/27	199 532	0,00
100 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.010%, 22/11/26	102 500	0,00	200 000 EUR	BNG Bank NV, 0.750%, 11/01/28	206 457	0,00
100 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.875%, 06/12/27	103 666	0,00	300 000 EUR	BNG Bank NV, 0.050%, 20/11/29	286 465	0,01
200 000 EUR	Allianz Finance II BV, 3.000%, 13/03/28	224 511	0,01	100 000 EUR	BNG Bank NV, 0.875%, 24/10/36	86 902	0,00
100 000 EUR	Allianz Finance II BV, 1.500%, 15/01/30	103 149	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
300 000 EUR	BP Capital Markets BV, 0.933%, 04/12/40	219 258	0,01	500 000 EUR	de Volksbank NV, 4.875%, 07/03/30	575 777	0,01
100 000 EUR	BP Capital Markets BV, 1.467%, 21/09/41	78 162	0,00	100 000 EUR	de Volksbank NV, 0.375%, 16/09/41	69 316	0,00
400 000 EUR	BP Capital Markets BV, 3.773%, perpetual	456 848	0,01	600 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.375%, 01/12/25	644 650	0,01
35 000 USD	CNH Industrial NV, 3.850%, 15/11/27	33 840	0,00	400 000 USD	Deutsche Telekom International Finance BV, 3.600%, 19/01/27	388 476	0,01
1 000 000 USD	Cooperatieve Rabobank UA, 5.000%, 13/01/25	999 240	0,02	100 000 GBP	Deutsche Telekom International Finance BV, 2.250%, 13/04/29	117 022	0,00
200 000 GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 1.250%, 14/01/25	245 338	0,01	200 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 2.000%, 01/12/29	213 827	0,01
250 000 USD	Cooperatieve Rabobank UA, 3.375%, 21/05/25	245 093	0,01	200 000 USD	Deutsche Telekom International Finance BV, 8.750%, 15/06/30	241 174	0,01
100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.250%, 23/03/26	106 490	0,00	15 000 USD	Deutsche Telekom International Finance BV, 9.250%, 01/06/32	19 483	0,00
150 000 USD	Cooperatieve Rabobank UA, 3.750%, 21/07/26	143 804	0,00	145 000 EUR	Diageo Capital BV, 0.125%, 28/09/28	141 091	0,00
400 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.250%, 30/10/26	411 738	0,01	100 000 EUR	Diageo Capital BV, 1.500%, 08/06/29	102 837	0,00
100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.375%, 03/02/27	105 030	0,00	100 000 EUR	Diageo Capital BV, 1.875%, 08/06/34	98 047	0,00
100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.375%, 01/12/27	101 327	0,00	100 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 0.625%, 15/07/25	104 648	0,00
500 000 USD	Cooperatieve Rabobank UA, 1.980%, 15/12/27	454 835	0,01	100 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 1.500%, 15/03/30	96 138	0,00
300 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.875%, 08/02/28	309 364	0,01	100 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 1.000%, 15/01/32	87 984	0,00
100 000 GBP	Cooperatieve Rabobank UA, 4.625%, 23/05/29	123 550	0,00	100 000 EUR	Digital Intrepid Holding BV, 0.625%, 15/07/31	86 663	0,00
600 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.010%, 02/07/30	557 844	0,01	100 000 EUR	Digital Intrepid Holding BV, 1.375%, 18/07/32	89 927	0,00
400 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.125%, 01/12/31	359 634	0,01	100 000 EUR	DSM BV, 0.250%, 23/06/28	99 433	0,00
100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.250%, 31/05/32	97 775	0,00	100 000 EUR	DSM BV, 0.625%, 23/06/32	91 216	0,00
500 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 3.875%, 30/11/32	552 209	0,01	200 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.625%, 30/05/26	214 634	0,01
500 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 2.875%, 19/01/33	554 904	0,01	50 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.250%, 19/10/27	51 932	0,00
100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.625%, 25/02/33	88 009	0,00	100 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.500%, 31/07/29	102 710	0,00
100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.500%, 26/04/38	91 031	0,00	100 000 GBP	E.ON International Finance BV, 4.750%, 31/01/34	125 114	0,00
150 000 USD	Cooperatieve Rabobank UA, 5.250%, 24/05/41	159 059	0,00	100 000 GBP	E.ON International Finance BV, 5.875%, 30/10/37	136 279	0,00
500 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.233%, perpetual	568 398	0,01	100 000 GBP	E.ON International Finance BV, 6.750%, 27/01/39	147 392	0,00
500 000 EUR	CTP NV, 0.875%, 20/01/26	512 127	0,01	200 000 EUR	Easyjet Finco Bv, 1.875%, perpetual	206 499	0,00
500 000 EUR	Daimler Truck International Finance BV, 3.875%, 19/06/29	570 381	0,01	1 000 000 USD	EDP Finance BV, 6.300%, 11/10/27	1 050 450	0,02
300 000 EUR	Danfoss Finance I BV, 0.375%, 28/10/28	290 179	0,01	100 000 EUR	ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group, 4.500%, perpetual	109 389	0,00
100 000 EUR	de Volksbank NV, 0.250%, 22/06/26	101 657	0,00	123 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.966%, 27/01/25	133 434	0,00
200 000 EUR	de Volksbank NV, 1.000%, 08/03/28	206 647	0,00	500 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.500%, 21/07/25	536 529	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.250%, 17/11/25	104 555	0,00	100 000 EUR	Heineken NV, 1.250%, 17/03/27	104 459	0,00
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.125%, 16/09/26	105 029	0,00	100 000 USD	Heineken NV, 3.500%, 29/01/28	97 079	0,00
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.010%, 17/06/27	99 535	0,00	300 000 EUR	Heineken NV, 2.250%, 30/03/30	317 715	0,01
300 000 GBP	Enel Finance International NV, 1.000%, 20/10/27	337 278	0,01	100 000 EUR	Heineken NV, 3.875%, 23/09/30	115 656	0,00
150 000 USD	Enel Finance International NV, 3.500%, 06/04/28	140 714	0,00	100 000 EUR	Heineken NV, 1.750%, 17/03/31	101 295	0,00
300 000 EUR	Enel Finance International NV, 3.875%, 09/03/29	342 334	0,01	300 000 EUR	Heineken NV, 1.250%, 07/05/33	280 857	0,01
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.500%, 17/06/30	92 511	0,00	100 000 EUR	Heineken NV, 4.125%, 23/03/35	118 425	0,00
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.875%, 17/01/31	93 187	0,00	200 000 USD	Heineken NV, 4.350%, 29/03/47	178 732	0,00
500 000 EUR	Enel Finance International NV, 4.000%, 20/02/31	571 005	0,01	200 000 USD	Iberdrola International BV, 6.750%, 15/07/36	232 790	0,01
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.125%, 17/10/34	85 399	0,00	600 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.825%, perpetual	564 306	0,01
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.250%, 17/01/35	86 661	0,00	100 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.874%, perpetual	103 964	0,00
50 000 GBP	Enel Finance International NV, 5.750%, 14/09/40	66 645	0,00	200 000 EUR	Iberdrola International BV, 2.250%, perpetual	197 187	0,00
300 000 EUR	Enel Finance International NV, 4.500%, 20/02/43	341 824	0,01	400 000 EUR	Imperial Brands Finance Netherlands BV, 5.250%, perpetual	457 330	0,01
100 000 USD	Enel Finance International NV, 4.750%, 25/05/47	87 121	0,00	100 000 EUR	ING Bank NV, 0.875%, 11/04/28	102 629	0,00
1 000 000 USD	Enel Finance International NV, 5.500%, perpetual	941 880	0,02	300 000 EUR	ING Bank NV, 0.750%, 18/02/29	301 556	0,01
200 000 EUR	Enexis Holding NV, 0.875%, 28/04/26	210 822	0,00	500 000 EUR	ING Bank NV, 2.500%, 21/02/30	546 062	0,01
100 000 EUR	Enexis Holding NV, 0.625%, 17/06/32	91 689	0,00	500 000 EUR	ING BANK NV, 0.125%, 08/12/31	450 311	0,01
100 000 EUR	Enexis Holding NV, 0.375%, 14/04/33	87 844	0,00	300 000 EUR	Ing Groep NV, 1.750%, 16/02/31	296 194	0,01
100 000 EUR	Enexis Holding NV, 3.625%, 12/06/34	116 373	0,00	100 000 EUR	ING Groep NV, 2.125%, 23/05/26	108 077	0,00
100 000 EUR	Essity Capital BV, 3.000%, 21/09/26	110 165	0,00	500 000 EUR	ING Groep NV, 1.250%, 16/02/27	525 300	0,01
100 000 EUR	Essity Capital BV, 0.250%, 15/09/29	96 064	0,00	100 000 EUR	ING Groep NV, 2.000%, 20/09/28	105 004	0,00
100 000 EUR	Euronext NV, 1.000%, 18/04/25	106 736	0,00	400 000 EUR	ING Groep NV, 0.375%, 29/09/28	392 226	0,01
200 000 EUR	Euronext NV, 0.750%, 17/05/31	184 189	0,00	200 000 GBP	ING Groep NV, 1.125%, 07/12/28	223 789	0,01
100 000 EUR	Euronext NV, 1.500%, 17/05/41	82 979	0,00	200 000 USD	ING Groep NV, 4.050%, 09/04/29	193 450	0,00
100 000 EUR	Exor NV, 1.750%, 14/10/34	92 469	0,00	100 000 EUR	ING Groep NV, 0.250%, 01/02/30	93 154	0,00
100 000 EUR	EXOR NV, 1.750%, 18/01/28	105 709	0,00	100 000 EUR	ING Groep NV, 2.000%, 22/03/30	106 825	0,00
200 000 EUR	Givaudan Finance Europe BV, 1.000%, 22/04/27	209 594	0,00	100 000 EUR	ING Groep NV, 1.000%, 13/11/30	103 489	0,00
100 000 EUR	Givaudan Finance Europe BV, 4.125%, 28/11/33	117 717	0,00	200 000 EUR	ING Groep NV, 2.125%, 26/05/31	210 763	0,00
100 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 0.625%, 24/07/25	97 918	0,00	100 000 EUR	ING Groep NV, 1.000%, 16/11/32	97 683	0,00
500 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 1.000%, 13/04/28	395 520	0,01	500 000 GBP	ING Groep NV, 6.250%, 20/05/33	641 995	0,01
100 000 EUR	Heimstaden Bostad Treasury BV, 1.375%, 24/07/28	79 139	0,00	500 000 USD	ING Groep NV, 6.114%, 11/09/34	526 165	0,01
				500 000 EUR	ING Groep NV, 0.250%, perpetual	479 275	0,01
				700 000 EUR	ING Groep NV, 4.750%, perpetual	822 658	0,01
				100 000 EUR	JAB Holdings BV, 2.500%, 17/04/27	107 965	0,00
				400 000 EUR	JAB Holdings BV, 1.000%, 14/07/31	374 454	0,01
				100 000 EUR	JAB Holdings BV, 4.750%, 29/06/32	117 555	0,00
				100 000 EUR	JAB Holdings BV, 3.375%, 17/04/35	105 206	0,00
				100 000 EUR	JAB Holdings BV, 2.250%, 19/12/39	85 990	0,00
				500 000 USD	JAB Holdings BV, 4.500%, perpetual	389 685	0,01
				100 000 EUR	JT International Financial Services BV, 1.000%, 26/11/29	97 940	0,00
				300 000 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.375%, 18/03/30	280 592	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
100 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 0.625%, 09/04/25	106 519	0,00	100 000 EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands, 0.500%, 21/09/28	97 441	0,00
100 000 GBP	Koninklijke KPN NV, 5.000%, 18/11/26	129 133	0,00	200 000 EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands, 0.125%, 24/09/29	190 517	0,00
100 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 0.875%, 14/12/32	89 999	0,00	200 000 EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands, 0.375%, 04/03/41	141 625	0,00
100 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 0.875%, 15/11/33	88 041	0,00	100 000 EUR	Naturgy Finance BV, 0.875%, 15/05/25	106 497	0,00
100 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 0.500%, 22/05/26	102 991	0,00	100 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.250%, 15/01/26	105 891	0,00
400 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 2.125%, 05/11/29	406 326	0,01	100 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.250%, 19/04/26	105 823	0,00
15 000 USD	Koninklijke Philips NV, 6.875%, 11/03/38	16 769	0,00	100 000 EUR	Naturgy Finance BV, 0.750%, 28/11/29	97 293	0,00
500 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 3.500%, 09/04/25	551 900	0,01	200 000 EUR	Nederlandse Gasunie NV, 1.000%, 11/05/26	211 328	0,00
100 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 0.250%, 23/02/26	102 928	0,00	100 000 AUD	Nederlandse Waterschapsbank NV, 3.400%, 22/07/25	67 229	0,00
100 000 EUR	Linde Finance BV, 0.250%, 19/05/27	101 450	0,00	300 000 EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.625%, 06/02/29	301 357	0,01
100 000 EUR	Linde Finance BV, 0.550%, 19/05/32	91 487	0,00	200 000 EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.500%, 29/04/30	194 743	0,00
300 000 EUR	Lseg Netherlands BV, 0.750%, 06/04/33	266 438	0,01	500 000 EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.250%, 19/01/32	458 264	0,01
100 000 USD	LYB International Finance BV, 5.250%, 15/07/43	95 867	0,00	300 000 EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 1.625%, 29/01/48	253 686	0,01
100 000 EUR	LYB International Finance II BV, 0.875%, 17/09/26	103 487	0,00	100 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.875%, 08/07/25	105 633	0,00
100 000 EUR	LYB International Finance II BV, 1.625%, 17/09/31	95 972	0,00	100 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.250%, 09/09/26	101 024	0,00
100 000 EUR	Madrikena Red de Gas Finance BV, 1.375%, 11/04/25	106 506	0,00	400 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.500%, 19/03/27	411 805	0,01
250 000 USD	MDGH GMTN RSC Ltd, 3.700%, 07/11/49	201 110	0,00	100 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.875%, 24/06/27	100 608	0,00
100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.000%, 11/11/25	106 020	0,00	100 000 EUR	NN Group NV, 1.625%, 01/06/27	106 260	0,00
100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.375%, 26/06/26	106 109	0,00	300 000 EUR	NN Group NV, 0.875%, 23/11/31	284 122	0,01
500 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.625%, 06/05/27	514 220	0,01	400 000 EUR	NN Group NV, 6.000%, 03/11/43	470 987	0,01
300 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.500%, perpetual	334 918	0,01	1 000 000 USD	Prosus NV, 3.257%, 19/01/27	926 600	0,02
125 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.700%, perpetual	144 325	0,00	200 000 USD	Prosus NV, 4.850%, 06/07/27	193 146	0,00
1 000 000 USD	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 4.250%, 15/09/25	987 440	0,02	500 000 EUR	Prosus NV, 2.778%, 19/01/34	430 609	0,01
125 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.010%, 22/09/26	127 767	0,00	100 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.375%, 19/05/26	104 177	0,00
500 000 USD	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 1.250%, 24/09/26	455 300	0,01	200 000 EUR	RELX Finance BV, 0.500%, 10/03/28	200 355	0,00
100 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.250%, 09/09/29	95 151	0,00	300 000 EUR	RELX Finance BV, 3.750%, 12/06/31	344 671	0,01
100 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.625%, 09/09/32	89 167	0,00	100 000 EUR	Ren Finance BV, 1.750%, 18/01/28	104 769	0,00
100 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 1.250%, 09/09/41	78 232	0,00	100 000 EUR	Repsol International Finance BV, 2.000%, 15/12/25	107 965	0,00
100 000 EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands, 0.375%, 26/02/25	106 425	0,00	100 000 EUR	Repsol International Finance BV, 2.625%, 15/04/30	108 514	0,00
				100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 0.875%, 25/02/25	107 856	0,00
				100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.204%, 27/08/29	113 380	0,00
				100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.355%, 27/02/35	115 281	0,00
				100 000 EUR	Royal Schiphol Group NV, 0.375%, 08/09/27	100 753	0,00

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
100 000 EUR	Royal Schiphol Group NV, 0.875%, 08/09/32	91 691	0,00	300 000 GBP	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.000%, 20/02/25	366 657	0,01
200 000 EUR	Schlumberger Finance BV, 1.375%, 28/10/26	210 993	0,00	300 000 USD	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.250%, 27/05/25	293 763	0,01
100 000 EUR	Schlumberger Finance BV, 0.250%, 15/10/27	99 960	0,00	100 000 GBP	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.750%, 10/09/25	124 412	0,00
100 000 USD	Shell International Finance BV, 3.250%, 11/05/25	98 111	0,00	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.010%, 20/02/26	104 070	0,00
100 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.875%, 15/09/25	108 202	0,00	500 000 USD	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.200%, 11/03/26	464 915	0,01
200 000 USD	Shell International Finance BV, 2.875%, 10/05/26	192 634	0,00	100 000 USD	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.350%, 15/10/26	94 366	0,00
50 000 USD	Shell International Finance BV, 2.500%, 12/09/26	47 618	0,00	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.625%, 25/02/27	103 332	0,00
100 000 EUR	Shell International Finance BV, 0.125%, 08/11/27	99 849	0,00	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.000%, 06/09/27	105 147	0,00
100 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.500%, 07/04/28	104 488	0,00	400 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.500%, 08/09/27	439 448	0,01
100 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.250%, 12/05/28	103 192	0,00	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.900%, 28/02/28	103 254	0,00
150 000 USD	Shell International Finance BV, 2.375%, 07/11/29	135 194	0,00	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.250%, 20/02/29	97 560	0,00
40 000 USD	Shell International Finance BV, 2.750%, 06/04/30	36 610	0,00	40 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.125%, 05/09/29	39 412	0,00
140 000 GBP	Shell International Finance BV, 1.000%, 10/12/30	146 160	0,00	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.000%, 25/02/30	99 551	0,00
100 000 EUR	Shell International Finance BV, 0.500%, 08/11/31	91 507	0,00	60 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.375%, 06/09/30	60 824	0,00
100 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.875%, 07/04/32	101 214	0,00	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.250%, 28/02/31	99 817	0,00
500 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.250%, 11/11/32	474 386	0,01	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.250%, 28/02/31	113 886	0,00
63 000 USD	Shell International Finance BV, 4.125%, 11/05/35	60 121	0,00	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.375%, 24/08/31	91 474	0,00
100 000 EUR	Shell International Finance BV, 0.875%, 08/11/39	76 235	0,00	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.500%, 20/02/32	34 363	0,00
100 000 USD	Shell International Finance BV, 3.625%, 21/08/42	84 832	0,00	40 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.500%, 05/09/34	92 176	0,00
150 000 USD	Shell International Finance BV, 4.550%, 12/08/43	142 335	0,00	1 500 000 USD	Shell International Finance BV, 2.875%, perpetual	1 139 175	0,02
150 000 USD	Shell International Finance BV, 4.375%, 11/05/45	137 993	0,00	500 000 EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.250%, 05/04/29	537 849	0,01
150 000 USD	Shell International Finance BV, 4.000%, 10/05/46	130 679	0,00				
100 000 USD	Shell International Finance BV, 3.750%, 12/09/46	83 408	0,00				
150 000 USD	Shell International Finance BV, 3.125%, 07/11/49	110 688	0,00				
450 000 USD	Shell International Finance BV, 3.250%, 06/04/50	339 629	0,01				
900 000 USD	Shell International Finance BV, 3.000%, 26/11/51	645 660	0,01				
115 000 GBP	Shell International Finance BV, 1.750%, 10/09/52	80 596	0,00				
1 500 000 USD	Shell International Finance BV, 2.875%, perpetual	1 139 175	0,02				
500 000 EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.250%, 05/04/29	537 849	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
500 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.500%, 24/02/36	571 353	0,01	100 000 EUR	TenneT Holding BV, 1.500%, 03/06/39	96 500	0,00
100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.625%, 24/02/43	114 947	0,00	100 000 EUR	TenneT Holding BV, 4.750%, 28/10/42	127 698	0,00
200 000 USD	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.300%, 15/09/46	158 446	0,00	100 000 EUR	TenneT Holding BV, 1.625%, perpetual	108 017	0,00
50 000 USD	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 4.200%, 16/03/47	45 694	0,00	100 000 EUR	TenneT Holding BV, 2.375%, perpetual	105 352	0,00
500 000 USD	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.875%, perpetual	391 255	0,01	100 000 EUR	TenneT Holding BV, 2.750%, perpetual	102 345	0,00
500 000 EUR	Sika Capital BV, 3.750%, 03/05/30	568 442	0,01	200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.010%, 18/11/25	208 456	0,00
100 000 EUR	Stedin Holding NV, 0.010%, 16/11/26	100 993	0,00	500 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.800%, 18/10/30	479 368	0,01
100 000 EUR	Stedin Holding NV, 0.500%, 14/11/29	95 157	0,00	300 000 GBP	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 4.625%, 08/06/26	383 228	0,01
100 000 EUR	Stedin Holding NV, 2.375%, 03/06/30	105 283	0,00	100 000 CHF	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 2.130%, 15/06/27	121 410	0,00
100 000 EUR	Stellantis NV, 0.625%, 30/03/27	101 794	0,00	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 0.500%, 06/01/25	107 379	0,00
500 000 EUR	Stellantis NV, 0.750%, 18/01/29	490 785	0,01	300 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.750%, 16/11/28	316 635	0,01
700 000 EUR	Stellantis NV, 4.250%, 16/06/31	802 299	0,01	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.375%, 31/07/29	102 505	0,00
100 000 EUR	Swisscom Finance BV, 0.375%, 14/11/28	98 639	0,00	200 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.750%, 25/03/30	207 312	0,00
500 000 EUR	Syngenta Finance NV, 3.375%, 16/04/26	548 497	0,01	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.375%, 04/09/30	100 850	0,00
100 000 EUR	Syngenta Finance NV, 1.250%, 10/09/27	100 807	0,00	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 3.250%, 23/02/31	112 949	0,00
300 000 USD	Syngenta Finance NV, 5.182%, 24/04/28	297 081	0,01	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.250%, 28/02/31	98 667	0,00
25 000 USD	Telefonica Europe BV, 8.250%, 15/09/30	29 333	0,00	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 2.250%, 16/05/34	103 415	0,00
22 000 EUR	Telefonica Europe BV, 5.875%, 14/02/33	29 179	0,00	100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 3.500%, 23/02/35	115 288	0,00
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 1.375%, 05/06/28	105 451	0,00	100 000 EUR	Upjohn Finance BV, 1.362%, 23/06/27	102 558	0,00
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 3.875%, 28/10/28	115 233	0,00	400 000 EUR	Upjohn Finance BV, 1.908%, 23/06/32	371 079	0,01
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 2.125%, 17/11/29	106 549	0,00	400 000 USD	Utah Acquisition Sub Inc, 3.950%, 15/06/26	387 316	0,01
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 0.875%, 03/06/30	101 905	0,00	100 000 EUR	Vesteda Finance BV, 2.000%, 10/07/26	106 176	0,00
400 000 EUR	TenneT Holding BV, 0.500%, 09/06/31	394 060	0,01	400 000 EUR	Vesteda Finance BV, 0.750%, 18/10/31	354 597	0,01
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 4.250%, 28/04/32	119 794	0,00	100 000 GBP	Volkswagen Financial Services NV, 0.875%, 20/02/25	121 032	0,00
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 0.125%, 30/11/32	97 348	0,00	100 000 GBP	Volkswagen Financial Services NV, 1.125%, 05/07/26	116 241	0,00
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 1.250%, 24/10/33	98 118	0,00	100 000 GBP	Volkswagen Financial Services NV, 3.250%, 13/04/27	120 676	0,00
100 000 EUR	TenneT Holding BV, 4.500%, 28/10/34	122 629	0,00	100 000 GBP	Volkswagen Financial Services NV, 2.125%, 18/01/28	113 687	0,00
200 000 EUR	TenneT Holding BV, 0.875%, 16/06/35	193 073	0,00	100 000 GBP	Volkswagen Financial Services NV, 1.375%, 14/09/28	108 401	0,00
				700 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.125%, 15/11/25	782 874	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Nouvelle-Zélande (suite)			
100 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 0.875%, 22/09/28	98 857	0,00	400 000 EUR	Westpac Securities NZ Ltd, 1.777%, 14/01/26	430 005	0,01
800 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.250%, 29/03/29	918 671	0,02	300 000 EUR	Westpac Securities NZ Ltd, 0.010%, 08/06/28	290 508	0,00
100 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.250%, 18/11/30	109 279	0,00	Nouvelle-Zélande – Total			
100 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.250%, 23/09/32	91 925	0,00	3 594 282			
100 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 4.125%, 16/11/38	114 364	0,00	0,05			
100 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.500%, perpetual	98 820	0,00	Norvège			
100 000 EUR	VolkswAGEN International Finance NV, 3.875%, perpetual	101 208	0,00	500 000 USD	Aker BP ASA, 5.600%, 13/06/28	509 380	0,01
200 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.125%, 08/09/25	211 485	0,01	500 000 USD	Aker BP ASA, 6.000%, 13/06/33	520 475	0,01
100 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.500%, 22/03/26	105 647	0,00	400 000 GBP	DNB Bank ASA, 4.000%, 17/08/27	497 162	0,01
100 000 EUR	Vonovia Finance BV, 0.625%, 09/07/26	103 021	0,00	400 000 EUR	DNB Bank ASA, 0.375%, 18/01/28	404 876	0,01
100 000 EUR	Vonovia Finance BV, 0.500%, 14/09/29	90 991	0,00	200 000 EUR	DNB Bank ASA, 0.250%, 23/02/29	193 789	0,00
100 000 EUR	Vonovia Finance BV, 2.125%, 22/03/30	98 871	0,00	182 000 EUR	DNB Bank ASA, 5.000%, 13/09/33	209 289	0,00
100 000 EUR	Vonovia Finance BV, 1.000%, 09/07/30	91 566	0,00	500 000 EUR	DNB Boligkreditt AS, 0.625%, 14/01/26	527 454	0,01
100 000 EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.332%, 25/09/28	98 793	0,00	400 000 EUR	DNB Boligkreditt AS, 0.010%, 08/10/27	398 752	0,01
100 000 EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.823%, 25/09/31	95 126	0,00	500 000 EUR	Eika Boligkreditt AS, 2.500%, 22/09/28	545 438	0,01
500 000 EUR	Wolters Kluwer NV, 3.000%, 23/09/26	553 308	0,01	200 000 EUR	Eika Boligkreditt AS, 0.875%, 01/02/29	200 788	0,00
100 000 EUR	Wolters Kluwer NV, 0.750%, 03/07/30	95 911	0,00	100 000 EUR	Equinor ASA, 2.875%, 10/09/25	109 929	0,00
100 000 EUR	WPC Eurobond BV, 2.250%, 09/04/26	106 909	0,00	100 000 EUR	Equinor ASA, 0.750%, 09/11/26	104 055	0,00
Pays-Bas – Total				81 291 237			
1,22				200 000 EUR			
Nouvelle-Zélande				Santander Consumer Bank AS, 0.125%, 25/02/25			
100 000 EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 1.125%, 20/03/25	107 228	0,00	200 000 EUR	SpareBank 1 Boligkreditt AS, 0.500%, 30/01/25	214 198	0,00
1 000 000 USD	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 5.355%, 14/08/28	1 022 100	0,02	300 000 EUR	SpareBank 1 Boligkreditt AS, 0.010%, 22/09/27	298 534	0,01
100 000 EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.375%, 17/09/29	94 667	0,00	500 000 EUR	SpareBank 1 Boligkreditt AS, 0.125%, 20/01/28	495 557	0,01
500 000 USD	ASB Bank Ltd, 1.625%, 22/10/26	456 460	0,01	100 000 EUR	SpareBank 1 Boligkreditt AS, 0.050%, 03/11/28	96 792	0,00
100 000 EUR	ASB Bank Ltd, 0.250%, 08/09/28	96 291	0,00	500 000 EUR	SpareBank 1 Boligkreditt AS, 3.000%, 19/05/30	558 130	0,01
100 000 EUR	ASB Bank Ltd, 0.500%, 24/09/29	95 207	0,00	100 000 EUR	SpareBank 1 SMN, 0.125%, 11/09/26	101 663	0,00
300 000 USD	Bank of New Zealand, 2.000%, 21/02/25	289 755	0,00	100 000 EUR	SpareBank 1 SMN, 0.010%, 18/02/28	97 017	0,00
200 000 EUR	BNZ International Funding Ltd, 0.625%, 03/07/25	212 281	0,00	100 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.250%, 09/11/26	101 506	0,00
500 000 USD	Westpac New Zealand Ltd, 4.902%, 15/02/28	499 780	0,01	100 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.375%, 15/07/27	101 230	0,00
				200 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 4.875%, 24/08/28	232 578	0,00
				200 000 EUR	Sparebanken Soer Boligkreditt AS, 0.500%, 06/02/26	210 131	0,00
				300 000 EUR	Sparebanken Vest Boligkreditt AS, 0.500%, 12/02/26	315 150	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Norvège (suite)				Singapour (suite)			
300 000 EUR	SR-Boligkreditt AS, 0.010%, 26/06/27	300 913	0,01	200 000 USD	SingTel Group Treasury Pte Ltd, 3.250%, 30/06/25	195 646	0,00
500 000 EUR	SR-Boligkreditt AS, 1.000%, 01/04/29	504 273	0,01	300 000 USD	SingTel Group Treasury Pte Ltd, 1.875%, 10/06/30	255 090	0,00
300 000 EUR	Statkraft AS, 2.875%, 13/09/29	332 127	0,01	100 000 USD	SP PowerAssets Ltd, 3.250%, 24/11/25	97 294	0,00
100 000 EUR	Statkraft AS, 1.500%, 26/03/30	101 442	0,00	100 000 USD	SP PowerAssets Ltd, 3.000%, 26/09/27	95 065	0,00
100 000 EUR	Statnett SF, 3.500%, 08/06/33	114 940	0,00	250 000 USD	Temasek Financial I Ltd, 3.625%, 01/08/28	245 060	0,00
300 000 EUR	Telenor ASA, 0.250%, 14/02/28	297 073	0,01	300 000 EUR	Temasek Financial I Ltd, 0.500%, 20/11/31	273 129	0,00
100 000 EUR	Telenor ASA, 1.125%, 31/05/29	100 387	0,00	100 000 GBP	Temasek Financial I Ltd, 5.125%, 26/07/40	137 640	0,00
100 000 EUR	Telenor ASA, 0.625%, 25/09/31	92 343	0,00	500 000 USD	Temasek Financial I Ltd, 2.375%, 02/08/41	380 110	0,01
100 000 EUR	Telenor ASA, 0.875%, 14/02/35	86 755	0,00	500 000 USD	United Overseas Bank Ltd, 3.059%, 07/04/25	489 325	0,01
Norvège – Total		10 508 706	0,16	Singapour – Total		5 560 649	0,08
Panama				Slovaquie			
500 000 USD	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA, 4.000%, 11/08/41	377 335	0,01	500 000 EUR	Vseobecna Uverova Banka AS, 3.875%, 05/09/28	569 348	0,01
300 000 USD	Empresa de Transmision Electrica SA, 5.125%, 02/05/49	219 051	0,00	Slovaquie – Total		569 348	0,01
Panama – Total		596 386	0,01	Espagne			
Philippines				500 000 EUR	Abanca Corp Bancaria SA, 5.875%, 02/04/30	588 519	0,01
500 000 USD	Development Bank of the Philippines, 2.375%, perpetual	408 075	0,01	100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 0.625%, 15/07/25	105 785	0,00
Philippines – Total		408 075	0,01	100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.000%, 27/02/27	103 857	0,00
Portugal				100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.375%, 27/09/27	107 606	0,00
500 000 EUR	Banco Santander Totta SA, 3.375%, 19/04/28	562 013	0,01	100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 4.125%, 31/01/28	101 190	0,00
100 000 EUR	Brisa-Concessao Rodoviaria SA, 1.875%, 30/04/25	108 121	0,00	200 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.250%, 29/03/29	207 440	0,00
Portugal – Total		670 134	0,01	100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.625%, 15/07/29	100 212	0,00
Qatar				100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 1.875%, 26/03/32	95 704	0,00
500 000 USD	QatarEnergy, 3.125%, 12/07/41	384 170	0,01	100 000 EUR	ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA, 1.875%, 20/04/26	106 917	0,00
Qatar – Total		384 170	0,01	100 000 EUR	Amadeus IT Group SA, 2.875%, 20/05/27	109 498	0,00
Arabie saoudite				100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.000%, 25/02/25	111 108	0,00
300 000 USD	Riyad Sukuk Ltd, 3.174%, 25/02/30	289 152	0,01	400 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.750%, 04/06/25	425 869	0,01
200 000 USD	Saudi Telecom Co, 3.890%, 13/05/29	190 982	0,00	100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.375%, 15/11/26	102 296	0,00
Arabie saoudite – Total		480 134	0,01	200 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.875%, 22/11/26	209 276	0,00
Singapour				100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.500%, 14/01/27	101 896	0,00
200 000 USD	BOC Aviation Ltd, 3.500%, 18/09/27	190 156	0,00				
500 000 USD	BOC Aviation Ltd, 2.625%, 17/09/30	430 505	0,01				
100 000 EUR	DBS Bank Ltd, 0.010%, perpetual	102 128	0,00				
300 000 USD	DBS Group Holdings Ltd, 3.300%, perpetual	289 533	0,01				
75 000 USD	Flex Ltd, 4.750%, 15/06/25	74 018	0,00				
100 000 USD	Flex Ltd, 3.750%, 01/02/26	96 870	0,00				
200 000 USD	Oil India International Pte Ltd, 4.000%, 21/04/27	193 150	0,00				
1 000 000 USD	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4.750%, 19/05/33	1 003 060	0,02				
1 000 000 USD	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5.340%, 19/05/63	1 012 870	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Espagne (suite)				Espagne (suite)			
100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.125%, 24/03/27	102 862	0,00	400 000 GBP	Banco Santander SA, 4.750%, 30/08/28	507 447	0,01
500 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.125%, 17/07/27	557 981	0,01	200 000 USD	Banco Santander SA, 3.306%, 27/06/29	184 620	0,00
700 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.875%, 14/01/29	701 103	0,01	400 000 EUR	Banco Santander SA, 4.250%, 12/06/30	461 695	0,01
300 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.000%, 16/01/30	318 736	0,01	100 000 EUR	Banco Santander SA, 4.875%, 18/10/31	117 624	0,00
200 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5.750%, 15/09/33	232 350	0,01	100 000 EUR	Banco Santander SA, 1.000%, 04/11/31	94 597	0,00
300 000 EUR	BanCo Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.375%, 14/10/29	352 001	0,01	400 000 EUR	Banco Santander SA, 0.100%, 27/02/32	349 918	0,01
200 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 0.875%, 22/07/25	212 623	0,00	400 000 USD	Banco Santander SA, 6.921%, 08/08/33	427 144	0,01
200 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 1.000%, 26/04/27	207 816	0,00	100 000 EUR	Banco Santander SA, 2.000%, 27/11/34	99 553	0,00
400 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 1.750%, 30/05/29	414 942	0,01	500 000 USD	Banco SAntander SA, 1.722%, 14/09/27	452 530	0,01
100 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 5.000%, 07/06/29	116 112	0,00	100 000 EUR	Bankinter SA, 1.000%, 05/02/25	107 382	0,00
100 000 EUR	Banco Santander SA, 1.125%, 17/01/25	107 478	0,00	200 000 EUR	Bankinter SA, 0.625%, 06/10/27	201 082	0,00
200 000 EUR	Banco Santander SA, 0.010%, 27/02/25	212 566	0,00	100 000 EUR	CaixaBank SA, 0.375%, 03/02/25	106 656	0,00
100 000 EUR	Banco Santander SA, 2.500%, 18/03/25	108 941	0,00	100 000 EUR	CaixaBank SA, 4.000%, 03/02/25	110 986	0,00
300 000 EUR	Banco Santander SA, 1.000%, 07/04/25	321 930	0,01	100 000 EUR	CaixaBank SA, 3.875%, 17/02/25	110 859	0,00
500 000 USD	Banco Santander SA, 5.147%, 18/08/25	497 375	0,01	100 000 EUR	CaixaBank SA, 0.625%, 27/03/25	106 708	0,00
500 000 EUR	Banco Santander SA, 1.375%, 05/01/26	529 763	0,01	100 000 EUR	CaixaBank SA, 1.125%, 27/03/26	105 197	0,00
100 000 EUR	Banco Santander SA, 1.500%, 25/01/26	107 164	0,00	300 000 EUR	CaixaBank SA, 1.375%, 19/06/26	314 719	0,01
100 000 EUR	Banco Santander SA, 3.875%, 06/02/26	112 373	0,00	100 000 EUR	CaixaBank SA, 0.375%, 18/11/26	103 966	0,00
1 000 000 USD	Banco Santander SA, 1.849%, 25/03/26	926 400	0,02	600 000 EUR	CaixaBank SA, 1.250%, 11/01/27	631 109	0,01
100 000 GBP	Banco Santander SA, 1.500%, 14/04/26	117 642	0,00	400 000 EUR	CaixaBank SA, 1.000%, 17/01/28	410 899	0,01
500 000 EUR	Banco Santander SA, 0.300%, 04/10/26	513 138	0,01	100 000 EUR	CaixaBank SA, 0.625%, 21/01/28	101 899	0,00
200 000 EUR	Banco Santander SA, 0.500%, 04/02/27	202 712	0,00	100 000 EUR	CaixaBank SA, 0.750%, 26/05/28	100 702	0,00
100 000 GBP	Banco Santander SA, 1.750%, 17/02/27	115 071	0,00	500 000 EUR	CaixaBank SA, 5.000%, 19/07/29	577 478	0,01
200 000 USD	Banco Santander SA, 4.250%, 11/04/27	193 862	0,00	100 000 EUR	CaixaBank SA, 2.250%, 17/04/30	106 652	0,00
500 000 EUR	Banco Santander SA, 2.375%, 08/09/27	543 510	0,01	200 000 EUR	CaixaBank SA, 4.250%, 06/09/30	229 350	0,01
500 000 EUR	Banco Santander SA, 3.875%, 16/01/28	565 504	0,01	600 000 EUR	CaixaBank SA, 5.375%, 14/11/30	715 117	0,01
100 000 EUR	Banco Santander SA, 0.200%, 11/02/28	97 693	0,00	300 000 EUR	CaixaBank SA, 1.250%, 18/06/31	308 443	0,01
700 000 EUR	Banco Santander SA, 3.250%, 14/02/28	785 179	0,01	100 000 EUR	Cepsa Finance SA, 0.750%, 12/02/28	98 915	0,00
1 000 000 USD	Banco Santander SA, 5.588%, 08/08/28	1 021 240	0,02	100 000 EUR	Criteria Caixa SA, 0.875%, 28/10/27	100 890	0,00
				200 000 EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 4.375%, 04/04/32	235 423	0,01
				200 000 EUR	Enagas Financiaciones SA, 0.750%, 27/10/26	208 465	0,00
				100 000 EUR	Enagas Financiaciones SA, 0.375%, 05/11/32	87 732	0,00
				100 000 EUR	FCC Aqualia SA, 2.629%, 08/06/27	108 005	0,00
				500 000 EUR	FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU, 5.250%, 30/10/29	592 849	0,01
				100 000 EUR	Ferrovial Emisiones SA, 1.375%, 31/03/25	107 520	0,00
				300 000 EUR	Ferrovial Emisiones SA, 0.540%, 12/11/28	293 868	0,01
				200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 0.875%, 16/06/25	213 069	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				
Espagne (suite)				Espagne (suite)				
100 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.125%, 22/11/28	111 893	0,00	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.807%, 21/05/32	99 160	0,00	
100 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.375%, 22/11/32	112 683	0,00	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.957%, 01/07/39	88 570	0,00	
500 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.625%, 13/07/33	572 352	0,01	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.864%, 13/07/40	86 208	0,00	
500 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 4.875%, perpetual	557 252	0,01	100 000 USD	Telefonica Emisiones SA, 5.213%, 08/03/47	92 913	0,00	
100 000 EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 2.000%, 17/04/26	106 899	0,00	250 000 USD	Telefonica Emisiones SA, 5.520%, 01/03/49	242 110	0,01	
500 000 EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 0.750%, 22/06/29	477 689	0,01	Espagne – Total			28 823 468	0,43
				Émissions supranationales				
200 000 EUR	Mapfre SA, 1.625%, 19/05/26	216 129	0,00	1 500 000 USD	African Development Bank, 0.875%, 23/03/26	1 392 960	0,02	
100 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 1.750%, 26/05/25	107 354	0,00	100 000 GBP	African Development Bank, 0.500%, 22/06/26	116 380	0,00	
100 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 2.375%, 18/09/29	104 629	0,00	1 000 000 USD	African Development Bank, 0.875%, 22/07/26	919 880	0,01	
100 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 1.375%, 01/06/30	93 652	0,00	500 000 AUD	African Development Bank, 1.100%, 16/12/26	311 370	0,01	
500 000 EUR	Programa Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos, 4.250%, 28/03/27	575 258	0,01	500 000 USD	African Development Bank, 4.625%, 04/01/27	507 345	0,01	
200 000 EUR	Programa Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos, 4.250%, 10/04/31	240 083	0,01	200 000 AUD	African Development Bank, 3.300%, 27/07/27	132 102	0,00	
100 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 1.125%, 24/04/25	107 434	0,00	500 000 USD	African Development Bank, 4.375%, 14/03/28	506 670	0,01	
100 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.375%, 24/07/28	99 909	0,00	300 000 EUR	African Development Bank, 0.875%, 24/05/28	309 762	0,01	
100 000 EUR	Redeia Corp SA, 0.875%, 14/04/25	106 901	0,00	200 000 CAD	Asian Development Bank, 1.625%, 28/01/25	146 821	0,00	
500 000 EUR	Redeia Corp SA, 4.625%, perpetual	562 206	0,01	300 000 GBP	Asian Development Bank, 1.125%, 10/06/25	364 217	0,01	
100 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.375%, 17/01/25	106 816	0,00	500 000 USD	Asian Development Bank, 4.625%, 13/06/25	500 550	0,01	
100 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.010%, 23/02/26	103 068	0,00	250 000 USD	Asian Development Bank, 0.375%, 03/09/25	233 668	0,00	
100 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.500%, 14/01/27	101 616	0,00	100 000 GBP	Asian Development Bank, 1.125%, 15/12/25	120 313	0,00	
300 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.528%, 17/01/25	324 240	0,01	500 000 USD	Asian Development Bank, 4.250%, 09/01/26	499 790	0,01	
100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.495%, 11/09/25	107 346	0,00	750 000 USD	Asian Development Bank, 0.500%, 04/02/26	693 885	0,01	
100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.447%, 22/01/27	105 370	0,00	1 100 000 USD	Asian Development Bank, 1.000%, 14/04/26	1 023 330	0,02	
100 000 USD	Telefonica Emisiones SA, 4.103%, 08/03/27	98 031	0,00	100 000 GBP	Asian Development Bank, 0.125%, 15/12/26	114 458	0,00	
100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.201%, 21/08/27	103 099	0,00	200 000 USD	Asian Development Bank, 2.625%, 12/01/27	191 642	0,00	
100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.715%, 12/01/28	104 493	0,00	200 000 USD	Asian Development Bank, 2.375%, 10/08/27	189 040	0,00	
100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.788%, 12/03/29	104 006	0,00	200 000 GBP	Asian Development Bank, 0.750%, 07/12/27	227 287	0,00	
100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 0.664%, 03/02/30	95 455	0,00	500 000 USD	Asian Development Bank, 2.750%, 19/01/28	476 400	0,01	
500 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.592%, 25/05/31	530 713	0,01	1 000 000 USD	Asian Development Bank, 3.750%, 25/04/28	989 720	0,02	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Émissions supranationales (suite)				Émissions supranationales (suite)			
800 000 CAD	Asian Development Bank, 3.300%, 24/05/28	600 686	0,01	300 000 USD	European Investment Bank, 1.625%, 14/03/25	289 518	0,00
1 000 000 USD	Asian Development Bank, 4.500%, 25/08/28	1 021 120	0,02	1 100 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 25/03/25	1 172 598	0,02
300 000 USD	Asian Development Bank, 1.875%, 24/01/30	265 389	0,00	90 000 GBP	European Investment Bank, 5.500%, 15/04/25	115 879	0,00
300 000 EUR	Asian Development Bank, 0.025%, 31/01/30	285 894	0,00	500 000 USD	European Investment Bank, 2.875%, 13/06/25	488 320	0,01
1 000 000 USD	Asian Development Bank, 3.125%, 27/04/32	936 900	0,01	300 000 GBP	European Investment Bank, 1.125%, 19/06/25	364 255	0,01
100 000 EUR	Asian Development Bank, 1.400%, 06/02/37	93 568	0,00	200 000 EUR	European Investment Bank, 0.375%, 16/07/25	213 211	0,00
500 000 USD	Asian Infrastructure Investment Bank, 0.500%, 27/01/26	462 080	0,01	300 000 EUR	European Investment Bank, 2.750%, 15/09/25	332 001	0,01
1 000 000 USD	Asian Infrastructure Investment Bank, 4.875%, 14/09/26	1 016 890	0,02	200 000 EUR	European Investment Bank, 4.500%, 15/10/25	228 024	0,00
100 000 GBP	Asian Infrastructure Investment Bank, 1.125%, 15/09/26	118 118	0,00	500 000 USD	European Investment Bank, 0.375%, 15/12/25	463 345	0,01
500 000 USD	Central American Bank for Economic Integration, 5.000%, 09/02/26	500 555	0,01	300 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 13/03/26	314 232	0,01
300 000 EUR	Corp Andina de Fomento, 1.625%, 03/06/25	321 983	0,01	500 000 USD	European Investment Bank, 0.375%, 26/03/26	459 655	0,01
200 000 EUR	Corp Andina de Fomento, 0.250%, 04/02/26	206 404	0,00	100 000 EUR	European Investment Bank, 0.375%, 14/04/26	105 389	0,00
100 000 USD	Council Of Europe Development Bank, 1.375%, 27/02/25	96 231	0,00	700 000 EUR	European Investment Bank, 0.375%, 15/05/26	737 260	0,01
400 000 EUR	Council Of Europe Development Bank, 0.010%, 10/04/26	416 762	0,01	200 000 GBP	European Investment Bank, 0.875%, 15/05/26	236 672	0,00
100 000 GBP	Council Of Europe Development Bank, 1.250%, 15/09/26	118 392	0,00	1 000 000 PLN	European Investment Bank, 2.750%, 25/08/26	238 047	0,00
300 000 EUR	Council Of Europe Development Bank, 1.000%, 13/04/29	308 191	0,01	300 000 EUR	European Investment Bank, 0.100%, 15/10/26	311 356	0,01
500 000 EUR	Council Of Europe Development Bank, 2.875%, 13/04/30	565 150	0,01	600 000 GBP	European Investment Bank, 0.125%, 14/12/26	687 650	0,01
200 000 EUR	Council Of Europe Development Bank, 0.010%, 20/01/31	185 804	0,00	1 000 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 22/12/26	1 030 970	0,02
150 000 CHF	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial, 3.000%, 15/05/26	185 152	0,00	200 000 EUR	European Investment Bank, 0.500%, 15/01/27	209 163	0,00
250 000 EUR	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial, 3.125%, 09/11/31	285 563	0,00	500 000 AUD	European Investment Bank, 1.800%, 19/01/27	318 555	0,01
500 000 EUR	Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial, 3.125%, 30/03/33	569 988	0,01	500 000 USD	European Investment Bank, 1.375%, 15/03/27	460 150	0,01
400 000 USD	European Bank for Reconstruction & Development, 0.500%, 28/01/26	370 204	0,01	200 000 EUR	European Investment Bank, 3.500%, 15/04/27	228 839	0,00
200 000 CHF	European Investment Bank, 1.625%, 04/02/25	237 983	0,00	200 000 USD	European Investment Bank, 2.375%, 24/05/27	189 538	0,00
100 000 USD	European Investment Bank, 1.875%, 10/02/25	96 996	0,00	1 000 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 17/06/27	1 018 421	0,02
200 000 GBP	European Investment Bank, 1.375%, 07/03/25	245 549	0,00	300 000 GBP	European Investment Bank, 0.750%, 22/07/27	343 898	0,01
				400 000 EUR	European Investment Bank, 0.875%, 14/01/28	416 648	0,01
				100 000 CAD	European Investment Bank, 1.000%, 28/01/28	68 521	0,00
				500 000 USD	European Investment Bank, 3.875%, 15/03/28	498 290	0,01
				500 000 GBP	European Investment Bank, 3.875%, 12/04/28	642 225	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Émissions supranationales (suite)				Émissions supranationales (suite)			
200 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 15/05/28	199 281	0,00	100 000 EUR	European Investment Bank, 2.625%, 15/03/35	109 407	0,00
1 000 000 EUR	European Investment Bank, 2.750%, 28/07/28	1 123 020	0,02	700 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 15/11/35	561 113	0,01
800 000 AUD	European Investment Bank, 4.200%, 21/08/28	546 125	0,01	200 000 USD	European Investment Bank, 4.875%, 15/02/36	214 476	0,00
900 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 28/09/28	889 736	0,01	150 000 EUR	European Investment Bank, 1.125%, 15/09/36	136 677	0,00
1 000 000 USD	European Investment Bank, 4.500%, 16/10/28	1 023 250	0,02	100 000 GBP	European Investment Bank, 3.875%, 08/06/37	125 702	0,00
900 000 EUR	European Investment Bank, 0.625%, 22/01/29	910 843	0,01	146 000 EUR	European Investment Bank, 4.000%, 15/10/37	182 798	0,00
200 000 GBP	European Investment Bank, 4.500%, 07/06/29	266 153	0,00	100 000 EUR	European Investment Bank, 0.500%, 13/11/37	81 464	0,00
100 000 EUR	European Investment Bank, 0.125%, 20/06/29	97 788	0,00	900 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 15/05/41	604 663	0,01
200 000 EUR	European Investment Bank, 0.250%, 14/09/29	195 943	0,00	100 000 EUR	European Investment Bank, 3.625%, 14/03/42	120 359	0,00
190 000 USD	European Investment Bank, 1.625%, 09/10/29	167 377	0,00	100 000 EUR	European Investment Bank, 1.000%, 14/11/42	79 407	0,00
700 000 EUR	European Investment Bank, 0.050%, 15/11/29	674 905	0,01	100 000 GBP	European Investment Bank, 4.500%, 07/03/44	131 200	0,00
650 000 EUR	European Investment Bank, 0.050%, 16/01/30	624 141	0,01	200 000 EUR	European Investment Bank, 1.500%, 15/11/47	166 274	0,00
370 000 EUR	European Investment Bank, 4.000%, 15/04/30	445 661	0,01	100 000 EUR	European Investment Bank, 1.500%, 16/10/48	81 609	0,00
1 000 000 USD	European Investment Bank, 3.625%, 15/07/30	979 980	0,02	300 000 EUR	European Investment Bank, 0.050%, 27/01/51	151 845	0,00
500 000 EUR	European Investment Bank, 2.750%, 30/07/30	561 488	0,01	50 000 GBP	European Investment Bank, 4.625%, 12/10/54	67 385	0,00
500 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 09/09/30	469 344	0,01	200 000 EUR	European Investment Bank, 0.250%, perpetual	144 864	0,00
300 000 EUR	European Investment Bank, 2.750%, 13/09/30	337 599	0,01	700 000 EUR	European Stability Mechanism, 0.010%, 14/03/25	746 787	0,01
400 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 15/11/30	374 388	0,01	300 000 EUR	European Stability Mechanism, 0.500%, 02/03/26	317 546	0,01
100 000 EUR	European Investment Bank, 0.010%, 14/01/31	92 904	0,00	700 000 EUR	European Stability Mechanism, 0.010%, 15/12/26	720 341	0,01
520 000 USD	European Investment Bank, 1.250%, 14/02/31	435 068	0,01	300 000 EUR	European Stability Mechanism, 0.750%, 15/03/27	314 650	0,01
200 000 EUR	European Investment Bank, 1.000%, 14/03/31	199 584	0,00	700 000 EUR	European Stability Mechanism, 1.000%, 23/06/27	736 703	0,01
200 000 EUR	European Investment Bank, 1.000%, 14/04/32	196 033	0,00	300 000 EUR	European Stability Mechanism, 0.500%, 05/03/29	300 807	0,01
100 000 EUR	European Investment Bank, 1.125%, 15/11/32	98 115	0,00	800 000 EUR	European Stability Mechanism, 0.010%, 04/03/30	760 910	0,01
900 000 EUR	European Investment Bank, 2.875%, 12/01/33	1 015 988	0,02	100 000 EUR	European Stability Mechanism, 1.125%, 03/05/32	98 720	0,00
500 000 USD	European Investment Bank, 3.750%, 14/02/33	491 360	0,01	100 000 EUR	European Stability Mechanism, 1.200%, 23/05/33	97 890	0,00
300 000 EUR	European Investment Bank, 1.125%, 13/04/33	291 737	0,00	100 000 EUR	European Stability Mechanism, 1.625%, 17/11/36	96 245	0,00
500 000 EUR	European Investment Bank, 3.000%, 15/07/33	569 701	0,01	500 000 EUR	European Stability Mechanism, 0.875%, 18/07/42	383 231	0,01
100 000 EUR	European Investment Bank, 3.000%, 14/10/33	114 037	0,00	100 000 EUR	European Stability Mechanism, 1.750%, 20/10/45	88 851	0,00
300 000 EUR	European Investment Bank, 0.050%, 13/10/34	250 223	0,00	100 000 EUR	European Stability Mechanism, 1.800%, 02/11/46	89 521	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Émissions supranationales (suite)				Émissions supranationales (suite)			
300 000 EUR	European Stability Mechanism, 1.850%, 01/12/55	247 479	0,00	1 400 000 EUR	European Union, 1.250%, 04/02/43	1 158 955	0,02
200 000 EUR	European Union, 0.500%, 04/04/25	214 638	0,00	400 000 EUR	European Union, 0.450%, 02/05/46	261 807	0,00
800 000 EUR	European Union, 0.010%, 04/11/25	844 430	0,01	1 700 000 EUR	European Union, 0.750%, 04/01/47	1 188 902	0,02
1 200 000 EUR	European Union, 0.010%, 04/03/26	1 260 282	0,02	500 000 EUR	European Union, 0.300%, 04/11/50	283 094	0,00
1 400 000 EUR	European Union, 0.010%, 06/07/26	1 454 153	0,02	1 500 000 EUR	European Union, 0.700%, 06/07/51	944 990	0,01
1 200 000 EUR	European Union, 0.250%, 22/10/26	1 250 035	0,02	500 000 USD	Inter-American Development Bank, 1.750%, 14/03/25	482 965	0,01
300 000 EUR	European Union, 2.875%, 04/04/28	337 870	0,01	200 000 GBP	Inter-American Development Bank, 1.250%, 15/12/25	241 088	0,00
900 000 EUR	European Union, 0.010%, 02/06/28	897 451	0,01	1 500 000 USD	Inter-American Development Bank, 4.500%, 15/05/26	1 510 290	0,02
1 000 000 EUR	European Union, 0.010%, 04/10/28	985 967	0,02	100 000 USD	Inter-American Development Bank, 2.375%, 07/07/27	94 574	0,00
1 600 000 EUR	European Union, 0.010%, 04/07/29	1 550 717	0,02	200 000 USD	Inter-American Development Bank, 0.625%, 16/09/27	176 834	0,00
50 000 EUR	European Union, 1.375%, 04/10/29	52 067	0,00	500 000 USD	Inter-American Development Bank, 4.000%, 12/01/28	499 610	0,01
900 000 EUR	European Union, 0.010%, 04/10/30	844 709	0,01	500 000 USD	Inter-American Development Bank, 1.125%, 20/07/28	440 735	0,01
200 000 EUR	European Union, 0.750%, 04/04/31	195 373	0,00	500 000 AUD	Inter-American Development Bank, 1.000%, 04/08/28	295 062	0,00
900 000 EUR	European Union, 0.010%, 22/04/31	831 069	0,01	200 000 USD	Inter-American Development Bank, 3.125%, 18/09/28	192 598	0,00
1 200 000 EUR	European Union, 0.010%, 04/07/31	1 099 436	0,02	700 000 CAD	Inter-American Development Bank, 4.600%, 01/03/29	557 946	0,01
100 000 EUR	European Union, 3.375%, 04/04/32	117 168	0,00	200 000 GBP	Inter-American Development Bank, 4.750%, 05/10/29	268 575	0,00
1 000 000 EUR	European Union, 1.000%, 06/07/32	972 644	0,02	150 000 USD	Inter-American Development Bank, 1.125%, 13/01/31	123 933	0,00
700 000 EUR	European Union, 1.250%, 04/04/33	688 777	0,01	500 000 USD	Inter-American Development Bank, 3.500%, 12/04/33	478 990	0,01
400 000 EUR	European Union, 0.010%, 04/07/35	322 341	0,01	1 000 000 USD	Inter-American Investment Corp, 4.125%, 15/02/28	997 820	0,02
100 000 EUR	European Union, 1.500%, 04/10/35	96 440	0,00	100 000 EUR	Inter-American Investment Corp, 3.125%, 07/06/30	113 648	0,00
200 000 EUR	European Union, 1.125%, 04/04/36	183 136	0,00	200 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 1.625%, 15/01/25	193 718	0,00
500 000 EUR	European Union, 0.250%, 22/04/36	406 920	0,01	200 000 CAD	International Bank for Reconstruction & Development, 1.900%, 16/01/25	147 341	0,00
1 000 000 EUR	European Union, 0.200%, 04/06/36	804 539	0,01	2 000 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 0.375%, 28/07/25	1 875 960	0,03
1 500 000 EUR	European Union, 0.400%, 04/02/37	1 226 576	0,02	300 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 2.500%, 29/07/25	290 970	0,00
1 000 000 EUR	European Union, 0.875%, 11/03/37	846 515	0,01	500 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 0.500%, 28/10/25	466 110	0,01
1 000 000 EUR	European Union, 1.125%, 04/06/37	889 221	0,01	100 000 CAD	International Bank for Reconstruction & Development, 0.625%, 14/01/26	70 794	0,00
600 000 EUR	European Union, 0.100%, 04/10/40	417 332	0,01				
500 000 EUR	European Union, 0.450%, 04/07/41	362 314	0,01				
100 000 EUR	European Union, 3.750%, 04/04/42	121 351	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Émissions supranationales (suite)				Émissions supranationales (suite)			
400 000 AUD	International Bank for Reconstruction & Development, 0.500%, 18/05/26	250 619	0,00	500 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 4.750%, 14/11/33	528 845	0,01
200 000 GBP	International Bank for Reconstruction & Development, 0.750%, 15/12/26	233 107	0,00	100 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.500%, 21/06/35	86 295	0,00
500 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.010%, 15/01/27	513 375	0,01	800 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 3.100%, 14/04/38	908 438	0,01
500 000 AUD	International Bank for Reconstruction & Development, 1.350%, 22/04/27	312 151	0,01	500 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.700%, 22/10/46	349 163	0,01
200 000 CAD	International Bank for Reconstruction & Development, 0.875%, 28/09/27	137 212	0,00	200 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.125%, 03/01/51	105 565	0,00
200 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.625%, 22/11/27	206 620	0,00	200 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.200%, 21/01/61	84 417	0,00
185 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 0.750%, 24/11/27	163 272	0,00	100 000 GBP	International Development Association, 0.375%, 22/09/27	112 125	0,00
200 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.010%, 24/04/28	199 343	0,00	400 000 GBP	International Development Association, 0.750%, 21/09/28	445 537	0,01
1 000 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 3.500%, 12/07/28	980 110	0,02	500 000 EUR	International Development Association, 0.010%, 15/07/31	456 066	0,01
100 000 GBP	International Bank for Reconstruction & Development, 0.625%, 14/07/28	111 540	0,00	700 000 EUR	International Development Association, 2.500%, 15/01/38	739 572	0,01
500 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 1.750%, 23/10/29	442 310	0,01	200 000 AUD	International Finance Corp., 4.000%, 03/04/25	135 885	0,00
200 000 GBP	International Bank for Reconstruction & Development, 1.000%, 21/12/29	219 419	0,00	300 000 GBP	International Finance Corp., 0.250%, 15/12/25	354 621	0,01
500 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 3.875%, 14/02/30	496 775	0,01	800 000 AUD	International Finance Corp., 4.450%, 14/05/27	551 164	0,01
200 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.010%, 21/02/30	190 170	0,00	300 000 AUD	International Finance Corp., 0.750%, 24/05/28	176 431	0,00
100 000 EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.500%, 16/04/30	97 915	0,00	1 500 000 USD	International Finance Corp., 4.500%, 13/07/28	1 533 030	0,02
500 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 4.000%, 25/07/30	499 885	0,01	200 000 USD	International Finance Corp., 0.750%, 27/08/30	162 372	0,00
500 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 1.250%, 10/02/31	416 230	0,01	500 000 USD	Nordic Investment Bank, 0.375%, 11/09/25	467 105	0,01
1 500 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 1.625%, 03/11/31	1 265 820	0,02	1 000 000 USD	Nordic Investment Bank, 5.000%, 15/10/25	1 010 030	0,02
1 000 000 USD	International Bank for Reconstruction & Development, 2.500%, 29/03/32	896 050	0,01	200 000 EUR	Nordic Investment Bank, 0.500%, 03/11/25	212 201	0,00
				100 000 GBP	Nordic Investment Bank, 0.125%, 15/12/26	114 096	0,00
				500 000 EUR	Nordic Investment Bank, 0.010%, 30/04/27	510 978	0,01
				Émissions supranationales – Total		102 569 107	1,54
				Suède			
				500 000 EUR	Electrolux AB, 4.500%, 29/09/28	565 106	0,01
				100 000 EUR	Essity AB, 1.625%, 30/03/27	105 753	0,00
				100 000 EUR	Essity AB, 0.250%, 08/02/31	94 092	0,00
				100 000 EUR	Investor AB, 1.500%, 12/09/30	100 497	0,00
				300 000 EUR	Investor AB, 0.375%, 29/10/35	240 049	0,00
				100 000 EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.125%, 19/02/25	105 989	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Suède (suite)				Suède (suite)			
100 000 EUR	Lansforsakringar Bank AB, 0.050%, 15/04/26	102 101	0,00	10 000 000 SEK	Stadshypotek AB, 1.000%, 01/03/27	937 363	0,01
300 000 EUR	Lansforsakringar Hypotek AB, 0.625%, 29/01/26	315 925	0,01	10 000 000 SEK	Stadshypotek AB, 2.500%, 01/12/27	979 564	0,02
4 000 000 SEK	Lansforsakringar Hypotek AB, 1.000%, 15/09/27	371 488	0,01	400 000 EUR	Stadshypotek AB, 0.010%, 24/11/28	386 362	0,01
5 000 000 SEK	Lansforsakringar Hypotek AB, 0.500%, 20/09/28	444 405	0,01	200 000 USD	Svensk Exportkredit AB, 0.500%, 26/08/25	186 976	0,00
100 000 EUR	Lansforsakringar Hypotek AB, 0.010%, 27/09/28	96 983	0,00	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.050%, 03/09/26	101 599	0,00
6 000 000 SEK	Lansforsakringar Hypotek AB, 3.000%, 19/09/29	596 824	0,01	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.125%, 03/11/26	101 517	0,00
500 000 EUR	Molnlycke Holding AB, 4.250%, 08/09/28	567 067	0,01	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.875%, 10/05/27	112 724	0,00
4 000 000 SEK	Nordea Hypotek AB, 0.500%, 16/09/26	372 500	0,01	300 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.750%, 01/11/27	340 028	0,01
8 000 000 SEK	Nordea Hypotek AB, 1.000%, 16/06/27	746 032	0,01	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.050%, 06/09/28	96 130	0,00
10 000 000 SEK	Nordea Hypotek AB, 3.500%, 20/09/28	1 018 441	0,02	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.375%, 23/02/29	100 884	0,00
100 000 EUR	SBAB Bank AB, 4.875%, 26/06/26	111 612	0,00	500 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 5.000%, 16/08/34	579 008	0,01
4 000 000 SEK	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1.000%, 17/12/25	381 192	0,01	200 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.750%, perpetual	223 731	0,00
100 000 GBP	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 5.500%, 01/06/26	129 720	0,00	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.500%, perpetual	93 544	0,00
100 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.000%, 09/11/26	112 396	0,00	200 000 EUR	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB, 0.500%, 29/01/25	214 187	0,00
500 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1.750%, 11/11/26	530 420	0,01	1 000 000 SEK	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB, 2.000%, 17/06/26	97 062	0,00
4 000 000 SEK	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.500%, 16/12/26	370 456	0,01	6 000 000 SEK	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB, 0.250%, 09/06/27	545 247	0,01
100 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.375%, 11/02/27	100 687	0,00	6 000 000 SEK	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB, 3.500%, 14/06/28	610 660	0,01
700 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.750%, 28/06/27	721 973	0,01	400 000 EUR	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB, 0.375%, 05/06/29	387 308	0,01
138 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.125%, 29/06/27	157 018	0,00	6 000 000 SEK	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB, 1.000%, 12/06/30	528 744	0,01
200 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.750%, 09/08/27	200 976	0,00	4 000 000 SEK	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB, 0.750%, 09/06/32	331 356	0,01
100 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.750%, 15/11/27	102 425	0,00	100 000 EUR	Swedbank AB, 4.125%, 13/11/28	114 443	0,00
6 000 000 SEK	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.000%, 06/12/27	598 550	0,01	200 000 GBP	Swedbank AB, 5.875%, 24/05/29	264 187	0,00
500 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 5.000%, 17/08/33	574 142	0,01	200 000 EUR	Swedbank AB, 4.375%, 05/09/30	229 009	0,00
100 000 EUR	SKF AB, 0.875%, 15/11/29	96 657	0,00	700 000 EUR	Swedbank AB, 4.625%, perpetual	781 367	0,01
100 000 EUR	SKF AB, 0.250%, 15/02/31	87 949	0,00	500 000 USD	Swedbank AB, 1.538%, perpetual	456 700	0,01
100 000 EUR	Stadshypotek AB, 0.500%, 11/07/25	106 216	0,00	700 000 EUR	Swedbank Hypotek AB, 3.125%, 05/07/28	784 344	0,01
10 000 000 SEK	Stadshypotek AB, 1.000%, 03/09/25	957 407	0,02	100 000 EUR	Telia Co AB, 3.875%, 01/10/25	111 761	0,00
300 000 EUR	Stadshypotek AB, 0.375%, 13/03/26	313 808	0,01	200 000 EUR	Telia Co AB, 0.125%, 27/11/30	180 661	0,00
6 000 000 SEK	Stadshypotek AB, 0.500%, 01/06/26	562 209	0,01	200 000 EUR	Telia Co AB, 1.375%, 11/05/81	205 189	0,00
100 000 EUR	Stadshypotek AB, 0.125%, 05/10/26	102 692	0,00	100 000 EUR	Vattenfall AB, 3.750%, 18/10/26	112 344	0,00
				400 000 EUR	Vattenfall AB, 0.125%, 12/02/29	382 306	0,01
				50 000 GBP	Vattenfall AB, 6.875%, 15/04/39	75 789	0,00
				200 000 EUR	Volvo Treasury AB, 1.625%, 26/05/25	215 495	0,00

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Suède (suite)				Suède (suite)			
500 000 EUR	Volvo Treasury AB, 2.625%, 20/02/26	545 874	0,01	500 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 2.250%, 05/07/52	733 773	0,01
100 000 EUR	Volvo Treasury AB, 3.625%, perpetual	112 366	0,00	500 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.125%, 16/04/25	583 247	0,01
Suède – Total				Suède – Total			
		23 687 586	0,36				
Suisse				Suisse			
100 000 CHF	Basler Kantonalbank, 0.300%, 22/06/27	114 203	0,00	200 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.250%, 01/12/25	232 384	0,00
200 000 CHF	Holcim Helvetia Finance AG, 0.375%, 19/10/26	230 048	0,00	200 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 1.375%, 19/03/27	237 764	0,00
100 000 CHF	Luzerner Kantonalbank AG, 0.200%, 11/04/25	116 672	0,00	700 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.010%, 13/03/28	786 588	0,01
300 000 CHF	Nestle SA, 0.750%, 28/06/28	348 280	0,01	500 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.500%, 19/05/28	573 000	0,01
100 000 CHF	Nestle SA, 1.875%, 28/06/29	122 419	0,00	400 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.375%, 24/07/28	455 087	0,01
200 000 CHF	Nestle SA, 2.250%, 08/11/29	250 261	0,00	200 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.375%, 24/10/28	226 969	0,00
100 000 CHF	Novartis AG, 0.625%, 13/11/29	114 790	0,00	500 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.750%, 19/08/30	570 641	0,01
400 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.250%, 17/11/25	464 801	0,01	500 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.010%, 25/07/31	534 492	0,01
700 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.250%, 27/04/26	810 234	0,01	200 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.100%, 03/10/31	214 899	0,00
500 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.125%, 13/08/27	568 633	0,01	200 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.500%, 20/02/32	221 080	0,00
300 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 1.375%, 13/08/27	356 838	0,01	500 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 2.125%, 21/09/38	651 868	0,01
500 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.010%, 25/02/28	562 098	0,01	300 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.700%, 04/03/39	323 105	0,00
400 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.375%, 21/03/28	456 541	0,01	400 000 CHF	Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, 0.100%, perpetual	438 196	0,01
500 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.375%, 10/07/28	569 025	0,01	500 000 CHF	Roche Kapitalmarkt AG, 0.750%, 25/02/31	571 372	0,01
500 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.125%, 15/11/28	560 084	0,01	300 000 CHF	Zuercher Kantonalbank, 0.250%, 27/01/26	347 582	0,01
200 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 1.375%, 20/09/29	237 873	0,00	Suisse – Total			
300 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.500%, 21/12/29	339 055	0,01			15 088 836	0,23
300 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 1.000%, 12/05/32	344 905	0,01	Thaïlande			
200 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.125%, 19/11/32	212 017	0,00	200 000 USD	PTTEP Treasury Center Co Ltd, 3.903%, 06/12/59	159 772	0,00
100 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 1.500%, 14/02/40	120 499	0,00	Thaïlande – Total			
500 000 CHF	Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG, 0.250%, 25/04/42	487 513	0,01			159 772	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Émirats arabes unis				Royaume-Uni (suite)			
500 000 USD	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC, 5.500%, 12/01/29	509 170	0,01	300 000 EUR	AstraZeneca PLC, 0.375%, 03/06/29	291 578	0,01
500 000 USD	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC, 8.000%, perpetual	531 000	0,01	250 000 USD	AstraZeneca PLC, 1.375%, 06/08/30	208 050	0,00
300 000 USD	Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 4.875%, 23/04/30	307 320	0,00	100 000 USD	AstraZeneca PLC, 6.450%, 15/09/37	117 149	0,00
500 000 USD	Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 3.400%, perpetual	374 820	0,01	25 000 USD	AstraZeneca PLC, 4.375%, 16/11/45	23 553	0,00
500 000 USD	Abu Dhabi Ports Co PJSC, 2.500%, 06/05/31	425 685	0,01	185 000 USD	AstraZeneca PLC, 4.375%, 17/08/48	174 388	0,00
99 090 USD	Acwa Power Management And Investments One Ltd, 5.950%, 15/12/39	96 724	0,00	515 000 USD	AstraZeneca PLC, 3.000%, 28/05/51	386 070	0,01
100 000 EUR	DP World Ltd/United Arab Emirates, 2.375%, 25/09/26	106 046	0,00	100 000 EUR	Aviva PLC, 1.875%, 13/11/27	107 827	0,00
300 000 USD	Emirates NBD Bank PJSC, 2.625%, 18/02/25	290 751	0,00	100 000 EUR	Aviva PLC, 3.375%, 04/12/45	107 700	0,00
500 000 USD	Emirates NBD Bank PJSC, 4.250%, perpetual	449 960	0,01	100 000 GBP	Aviva PLC, 4.375%, 12/09/49	119 051	0,00
1 000 000 USD	MDGH GMTN RSC Ltd, 3.375%, 28/03/32	916 230	0,01	100 000 GBP	Aviva PLC, 5.125%, 04/06/50	121 669	0,00
500 000 USD	MDGH GMTN RSC Ltd, 3.400%, 07/06/51	372 825	0,01	200 000 GBP	Aviva PLC, 4.000%, 03/06/55	209 613	0,00
300 000 USD	Nbk Spc Ltd, 1.625%, 15/09/27	271 998	0,00	50 000 USD	AXIS Specialty Finance PLC, 4.000%, 06/12/27	47 919	0,00
Émirats arabes unis – Total		4 652 529	0,07	200 000 USD	Barclays PLC, 3.811%, 10/03/42	150 816	0,00
Royaume-Uni				200 000 USD	Barclays PLC, 3.650%, 16/03/25	195 580	0,00
100 000 GBP	Affordable Housing Finance PLC, 2.893%, 11/08/43	102 611	0,00	100 000 USD	Barclays PLC, 4.375%, 12/01/26	98 548	0,00
100 000 EUR	Ancor UK Finance PLC, 1.125%, 23/06/27	102 882	0,00	100 000 EUR	Barclays PLC, 1.375%, 24/01/26	107 288	0,00
100 000 GBP	Anglian Water Services Financing PLC, 4.500%, 05/10/27	126 300	0,00	500 000 USD	Barclays PLC, 2.852%, 07/05/26	482 720	0,01
200 000 GBP	Anglian Water Services Financing PLC, 5.875%, 20/06/31	269 207	0,01	100 000 GBP	Barclays PLC, 3.000%, 08/05/26	120 891	0,00
300 000 USD	Anglo American Capital PLC, 4.500%, 15/03/28	291 990	0,01	500 000 USD	Barclays PLC, 5.304%, 09/08/26	498 015	0,01
100 000 GBP	Annington Funding PLC, 3.184%, 12/07/29	114 008	0,00	300 000 GBP	Barclays PLC, 1.700%, 03/11/26	357 826	0,01
100 000 GBP	Annington Funding PLC, 2.308%, 06/10/32	99 337	0,00	100 000 EUR	Barclays PLC, 2.885%, 31/01/27	108 619	0,00
300 000 GBP	Annington Funding PLC, 4.750%, 09/08/33	356 644	0,01	200 000 GBP	Barclays PLC, 3.250%, 12/02/27	240 782	0,01
100 000 GBP	Annington Funding PLC, 3.685%, 12/07/34	107 425	0,00	500 000 USD	Barclays PLC, 6.496%, 13/09/27	514 915	0,01
100 000 EUR	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.200%, 23/09/27	98 793	0,00	500 000 USD	Barclays PLC, 2.279%, 24/11/27	458 945	0,01
200 000 USD	Aon Global Ltd, 4.750%, 15/05/45	185 014	0,00	100 000 USD	Barclays PLC, 4.337%, 10/01/28	97 186	0,00
39 650 GBP	Aspire Defence Finance PLC, 4.674%, 31/03/40	49 827	0,00	500 000 EUR	Barclays PLC, 0.877%, 28/01/28	507 029	0,01
100 000 GBP	Aster Treasury Plc, 1.405%, 27/01/36	91 023	0,00	100 000 GBP	Barclays PLC, 7.090%, 06/11/29	135 832	0,00
50 000 USD	AstraZeneca PLC, 3.375%, 16/11/25	48 912	0,00	100 000 EUR	Barclays PLC, 1.125%, 22/03/31	101 779	0,00
200 000 USD	AstraZeneca PLC, 3.125%, 12/06/27	192 320	0,00	200 000 USD	Barclays PLC, 2.667%, 10/03/32	164 914	0,00
70 000 USD	AstraZeneca PLC, 4.000%, 17/01/29	69 164	0,00	500 000 EUR	Barclays PLC, 1.106%, 12/05/32	450 311	0,01
				100 000 GBP	Barclays PLC, 3.250%, 17/01/33	109 148	0,00
				1 000 000 USD	Barclays PLC, 6.692%, 13/09/34	1 071 610	0,02
				100 000 USD	Barclays PLC, 4.950%, 10/01/47	93 870	0,00
				100 000 USD	BAT International Finance PLC, 3.950%, 15/06/25	97 941	0,00
				150 000 USD	BAT International Finance PLC, 1.668%, 25/03/26	139 341	0,00
				100 000 GBP	BAT International Finance PLC, 4.000%, 04/09/26	124 626	0,00
				100 000 EUR	BAT International Finance PLC, 1.250%, 13/03/27	102 717	0,00
				100 000 GBP	BAT International Finance PLC, 2.250%, 26/06/28	113 554	0,00
				1 000 000 USD	BAT International Finance PLC, 5.931%, 02/02/29	1 040 220	0,02
				60 000 GBP	BAT International Finance PLC, 5.750%, 05/07/40	69 273	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
70 000 GBP	BG Energy Capital PLC, 5.125%, 01/12/25	90 330	0,00	36 990 GBP	CTRL Section 1 Finance PLC, 5.234%, 02/05/35	50 589	0,00
100 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.953%, 03/03/25	108 485	0,00	1 000 000 USD	Diageo Capital PLC, 5.375%, 05/10/26	1 022 450	0,02
100 000 USD	BP Capital Markets PLC, 3.279%, 19/09/27	96 243	0,00	200 000 USD	Diageo Capital PLC, 2.375%, 24/10/29	180 186	0,00
400 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 2.519%, 07/04/28	433 761	0,01	1 000 000 USD	Diageo Capital PLC, 5.625%, 05/10/33	1 079 650	0,02
100 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.637%, 26/06/29	102 576	0,00	35 000 USD	Diageo Capital PLC, 5.875%, 30/09/36	38 664	0,00
500 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.231%, 08/05/31	482 158	0,01	100 000 GBP	Diageo Finance PLC, 1.750%, 12/10/26	120 019	0,00
100 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 2.822%, 07/04/32	107 381	0,00	300 000 EUR	Diageo Finance PLC, 1.875%, 27/03/27	320 751	0,01
100 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 1.104%, 15/11/34	87 190	0,00	100 000 EUR	Diageo Finance PLC, 2.500%, 27/03/32	105 908	0,00
400 000 EUR	British Telecommunications PLC, 0.500%, 12/09/25	420 938	0,01	100 000 GBP	Diageo Finance PLC, 1.250%, 28/03/33	99 720	0,00
200 000 USD	British Telecommunications PLC, 5.125%, 04/12/28	203 000	0,00	100 000 EUR	DS Smith PLC, 0.875%, 12/09/26	103 063	0,00
100 000 EUR	British Telecommunications PLC, 1.125%, 12/09/29	99 124	0,00	100 000 EUR	DS Smith PLC, 4.375%, 27/07/27	113 671	0,00
125 000 USD	British Telecommunications PLC, 9.625%, 15/12/30	154 899	0,00	200 000 EUR	DS Smith PLC, 4.500%, 27/07/30	230 163	0,00
100 000 GBP	British Telecommunications PLC, 3.125%, 21/11/31	114 751	0,00	100 000 GBP	DWR Cymru Financing UK PLC, 1.625%, 31/03/26	117 907	0,00
200 000 GBP	British Telecommunications PLC, 3.625%, 21/11/47	198 721	0,00	100 000 GBP	DWR Cymru Financing UK PLC, 1.375%, 31/03/33	97 101	0,00
400 000 EUR	British Telecommunications PLC, 2.750%, 30/08/27	436 628	0,01	200 000 GBP	Eastern Power Networks PLC, 1.875%, 01/06/35	192 762	0,00
100 000 GBP	Broadgate Financing PLC, 4.999%, 05/10/31	124 640	0,00	82 143 GBP	Eversholt Funding PLC, 6.697%, 22/02/35	112 355	0,00
100 000 GBP	Cadent Finance PLC, 2.125%, 22/09/28	114 347	0,00	87 180 GBP	Eversholt Funding PLC, 2.742%, 30/06/40	92 893	0,00
100 000 EUR	Cadent Finance PLC, 0.625%, 19/03/30	93 031	0,00	300 000 USD	Experian Finance PLC, 2.750%, 08/03/30	263 562	0,01
300 000 GBP	Cadent Finance PLC, 2.250%, 10/10/35	284 589	0,01	300 000 GBP	Experian Finance PLC, 3.250%, 07/04/32	355 007	0,01
150 000 GBP	Centrica PLC, 4.375%, 13/03/29	189 069	0,00	18 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 4.000%, 16/06/25	20 077	0,00
100 000 GBP	Channel Link Enterprises Finance PLC, 3.848%, 30/06/50	91 872	0,00	100 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.250%, 21/05/26	106 279	0,00
100 000 GBP	Circle Anglia Social Housing PLC, 5.200%, 02/03/44	125 326	0,00	100 000 GBP	GlaxoSmithKline Capital PLC, 3.375%, 20/12/27	126 196	0,00
300 000 GBP	Clarion Funding PLC, 1.875%, 22/01/35	284 726	0,01	200 000 GBP	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.250%, 12/10/28	227 600	0,00
100 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1.750%, 26/05/28	104 881	0,00	300 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.750%, 21/05/30	310 421	0,01
100 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 0.200%, 02/12/28	96 394	0,00	100 000 GBP	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.625%, 12/05/35	97 414	0,00
100 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 0.700%, 12/09/31	92 439	0,00	150 000 GBP	GlaxoSmithKline Capital PLC, 4.250%, 18/12/45	178 785	0,00
100 000 GBP	Community Finance Co 1 PLC, 5.017%, 31/07/34	130 603	0,00	200 000 GBP	Grainger PLC, 3.000%, 03/07/30	218 378	0,00
100 000 GBP	Compass Group PLC, 2.000%, 03/07/29	114 988	0,00	87 700 GBP	Greene King Finance PLC, 3.593%, 15/03/35	99 591	0,00
1 000 000 USD	CSL Finance PLC, 4.625%, perpetual	953 220	0,02	400 000 EUR	GSK Capital BV, 3.000%, 28/11/27	445 404	0,01
				100 000 GBP	Guinness Partnership Ltd, 2.000%, 22/04/55	68 448	0,00
				500 000 USD	Haleon UK Capital PLC, 3.125%, 24/03/25	488 290	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
300 000 CAD	Heathrow Funding Ltd, 2.694%, 13/10/27	212 771	0,00	500 000 GBP	HSBC Holdings PLC, 8.201%, 16/11/34	703 664	0,01
100 000 GBP	High Speed Rail Finance 1 PLC, 4.375%, 01/11/38	119 548	0,00	200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.500%, 02/05/36	208 400	0,00
200 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.000%, 30/06/25	218 646	0,00	100 000 GBP	HSBC Holdings PLC, 6.000%, 29/03/40	128 088	0,00
200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.300%, 08/03/26	196 764	0,00	300 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.100%, 14/01/42	341 799	0,01
610 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.999%, 10/03/26	591 688	0,01	1 000 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.332%, 09/03/44	1 081 680	0,02
200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 3.900%, 25/05/26	194 818	0,00	200 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.856%, perpetual	234 221	0,00
200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.099%, 04/06/26	190 430	0,00	200 000 USD	Imperial Brands Finance PLC, 4.250%, 21/07/25	196 346	0,00
100 000 GBP	HSBC Holdings PLC, 2.256%, 13/11/26	120 832	0,00	200 000 EUR	Imperial Brands Finance PLC, 2.125%, 12/02/27	213 021	0,00
250 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.375%, 23/11/26	244 277	0,01	100 000 EUR	Informa PLC, 1.250%, 22/04/28	101 163	0,00
100 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.019%, 15/06/27	109 111	0,00	100 000 GBP	InterContinental Hotels Group PLC, 2.125%, 24/08/26	118 618	0,00
300 000 GBP	HSBC Holdings PLC, 1.750%, 24/07/27	351 256	0,01	100 000 EUR	InterContinental Hotels Group PLC, 2.125%, 15/05/27	106 492	0,00
1 500 000 USD	HSBC Holdings PLC, 5.887%, 14/08/27	1 522 005	0,02	100 000 USD	Invesco Finance PLC, 3.750%, 15/01/26	97 375	0,00
500 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.251%, 22/11/27	459 190	0,01	33 445 GBP	Juturna European Loan Conduit No 16 PLC, 5.064%, 10/08/33	43 259	0,00
100 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.752%, 10/03/28	114 570	0,00	300 000 GBP	Land Securities Capital Markets PLC, 2.375%, 29/03/27	356 522	0,01
100 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.041%, 13/03/28	96 418	0,00	100 000 GBP	Land Securities Capital Markets PLC, 2.625%, 22/09/37	100 276	0,00
500 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.755%, 09/06/28	493 280	0,01	50 000 GBP	LCR Finance PLC, 4.500%, 07/12/28	65 808	0,00
300 000 GBP	HSBC Holdings PLC, 3.000%, 22/07/28	356 006	0,01	150 000 GBP	LCR Finance PLC, 5.100%, 07/03/51	214 335	0,00
100 000 GBP	HSBC Holdings PLC, 2.625%, 16/08/28	117 347	0,00	100 000 GBP	Legal & General Group PLC, 5.375%, 27/10/45	126 667	0,00
150 000 GBP	HSBC Holdings PLC, 6.750%, 11/09/28	204 036	0,00	100 000 GBP	Legal & General Group PLC, 3.750%, 26/11/49	114 747	0,00
500 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.161%, 09/03/29	516 525	0,01	100 000 GBP	Legal & General Group PLC, 4.500%, 01/11/50	117 349	0,00
200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.583%, 19/06/29	194 200	0,00	100 000 GBP	Liberty Living Finance PLC, 3.375%, 28/11/29	116 986	0,00
200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.206%, 17/08/29	174 782	0,00	300 000 EUR	Linde PLC, 0.010%, perpetual	305 994	0,01
300 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 0.641%, 24/09/29	290 736	0,01	100 000 EUR	Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 0.375%, 28/01/25	106 631	0,00
500 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.950%, 31/03/30	496 350	0,01	200 000 EUR	Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 2.375%, 09/04/26	216 984	0,00
200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.848%, 04/06/31	172 326	0,00	100 000 EUR	Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 4.125%, perpetual	113 076	0,00
200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.357%, 18/08/31	166 178	0,00	700 000 EUR	Lloyds Bank PLC, 0.125%, 18/06/26	721 942	0,01
900 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.787%, 10/03/32	1 051 142	0,02	100 000 GBP	Lloyds Bank PLC, 4.875%, 30/03/27	130 053	0,00
500 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.762%, 29/03/33	466 520	0,01	100 000 GBP	Lloyds Bank PLC, 6.000%, 08/02/29	138 730	0,00
500 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.547%, 20/06/34	523 665	0,01	300 000 EUR	Lloyds Bank PLC, 0.125%, 23/09/29	284 430	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
100 000 GBP	Lloyds Bank PLC, 6.500%, 17/09/40	152 225	0,00	100 000 GBP	Motability Operations Group PLC, 4.375%, 08/02/27	127 414	0,00
500 000 USD	Lloyds banking group PLC, 4.716%, 11/08/26	493 535	0,01	100 000 GBP	Motability Operations Group PLC, 2.375%, 03/07/39	95 555	0,00
500 000 USD	Lloyds banking group PLC, 7.953%, 15/11/33	573 280	0,01	100 000 GBP	Motability Operations Group PLC, 1.500%, 20/01/41	80 244	0,00
200 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 4.582%, 10/12/25	195 800	0,00	300 000 GBP	Motability Operations Group PLC, 2.125%, 18/01/42	262 824	0,01
200 000 GBP	Lloyds Banking Group PLC, 1.875%, 15/01/26	244 943	0,01	100 000 GBP	National Gas Transmission PLC, 1.125%, 14/01/33	92 777	0,00
200 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 4.650%, 24/03/26	196 666	0,00	100 000 GBP	National Grid Electricity Distribution South West PLC, 2.375%, 16/05/29	113 869	0,00
400 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 3.500%, 01/04/26	440 530	0,01	100 000 GBP	National Grid Electricity Distribution South West PLC, 5.818%, 31/07/41	136 424	0,00
100 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 3.750%, 11/01/27	96 137	0,00	300 000 GBP	National Grid Electricity Transmission PLC, 1.125%, 07/07/28	331 992	0,01
1 000 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 5.985%, 07/08/27	1 018 580	0,02	100 000 GBP	National Grid Electricity Transmission PLC, 5.272%, 18/01/43	128 470	0,00
200 000 GBP	Lloyds Banking Group PLC, 2.000%, 12/04/28	232 138	0,00	100 000 EUR	National Grid PLC, 2.179%, 30/06/26	107 397	0,00
300 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 3.574%, 07/11/28	282 459	0,01	100 000 EUR	National Grid PLC, 0.163%, 20/01/28	97 853	0,00
100 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 4.500%, 11/01/29	114 729	0,00	155 000 EUR	National Grid PLC, 0.553%, 18/09/29	147 193	0,00
500 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 5.871%, 06/03/29	513 150	0,01	100 000 EUR	National Grid PLC, 2.949%, 30/03/30	107 580	0,00
500 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 4.750%, 21/09/31	583 565	0,01	100 000 EUR	National Grid PLC, 3.245%, 30/03/34	104 961	0,00
400 000 GBP	Lloyds Banking Group PLC, 6.625%, 02/06/33	521 199	0,01	500 000 EUR	National Grid PLC, 4.275%, 16/01/35	571 623	0,01
100 000 GBP	London & Quadrant Housing Trust, 2.625%, 05/05/26	121 154	0,00	500 000 EUR	Nationwide Building Society, 0.250%, 22/07/25	525 686	0,01
300 000 GBP	London & Quadrant Housing Trust, 2.000%, 20/10/38	261 092	0,01	100 000 GBP	Nationwide Building Society, 5.625%, 28/01/26	130 445	0,00
100 000 GBP	London & Quadrant Housing Trust, 3.125%, 28/02/53	89 751	0,00	100 000 USD	Nationwide Building Society, 4.000%, 14/09/26	95 898	0,00
100 000 GBP	London Power Networks PLC, 5.875%, 15/11/40	140 589	0,00	500 000 USD	Nationwide Building Society, 1.500%, 13/10/26	454 665	0,01
100 000 EUR	London Stock Exchange Group PLC, 1.750%, 06/12/27	105 791	0,00	300 000 USD	Nationwide Building Society, 5.264%, 10/11/26	305 652	0,01
300 000 USD	LSEGA Financing PLC, 2.000%, 06/04/28	268 278	0,01	100 000 EUR	Nationwide Building Society, 2.000%, 28/04/27	106 218	0,00
100 000 GBP	M&G PLC, 5.625%, 20/10/51	121 510	0,00	500 000 USD	Nationwide Building Society, 2.972%, 16/02/28	465 170	0,01
100 000 GBP	M&G PLC, 6.340%, 19/12/63	122 010	0,00	300 000 EUR	Nationwide Building Society, 1.125%, 31/05/28	308 393	0,01
300 000 GBP	M&G PLC, 6.250%, 20/10/68	360 021	0,01	100 000 EUR	Nationwide Building Society, 0.250%, 14/09/28	96 408	0,00
100 000 GBP	Manchester Airport Group Funding PLC, 4.750%, 31/03/34	126 748	0,00	200 000 EUR	Nationwide Building Society, 2.250%, 25/06/29	214 516	0,00
100 000 GBP	Manchester Airport Group Funding PLC, 2.875%, 31/03/39	98 217	0,00	100 000 GBP	Nats En Route PLC, 1.750%, 30/09/33	100 014	0,00
100 000 GBP	Manchester Airport Group Funding PLC, 2.875%, 30/09/44	90 450	0,00	200 000 EUR	Natwest Group PLC, 1.750%, 02/03/26	215 122	0,00
100 000 GBP	Martlet Homes Ltd, 3.000%, 09/05/52	91 626	0,00				
100 000 EUR	Mondi Finance PLC, 1.625%, 27/04/26	106 636	0,00				
200 000 EUR	Motability Operations Group PLC, 0.375%, 03/01/26	208 991	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
300 000 GBP	NatWest Group PLC, 2.875%, 19/09/26	366 316	0,01	500 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3.875%, 14/09/33	584 763	0,01
100 000 GBP	NatWest Group PLC, 2.057%, 09/11/28	113 745	0,00	100 000 GBP	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 5.625%, 14/12/38	143 222	0,00
300 000 GBP	NatWest Group PLC, 3.619%, 29/03/29	358 446	0,01	400 000 EUR	Rentokil Initial Finance BV, 3.875%, 27/06/27	450 366	0,01
200 000 USD	NatWest Group PLC, 4.892%, 18/05/29	196 746	0,00	100 000 GBP	Rentokil Initial PLC, 5.000%, 27/06/32	128 425	0,00
400 000 GBP	NatWest Group PLC, 7.416%, 06/06/33	532 780	0,01	100 000 USD	Rio Tinto Finance USA PLC, 4.125%, 21/08/42	90 579	0,00
300 000 USD	NatWest Markets PLC, 3.479%, 22/03/25	293 916	0,01	300 000 GBP	RL Finance Bonds NO 4 PLC, 4.875%, 07/10/49	306 564	0,01
500 000 EUR	NatWest Markets PLC, 2.000%, 27/08/25	538 589	0,01	500 000 USD	Royalty Pharma PLC, 1.200%, 02/09/25	466 615	0,01
100 000 EUR	NatWest Markets PLC, 0.125%, 12/11/25	104 067	0,00	500 000 USD	Royalty Pharma PLC, 1.750%, 02/09/27	448 760	0,01
500 000 EUR	NatWest Markets PLC, 0.125%, 18/06/26	511 812	0,01	640 000 USD	Royalty Pharma PLC, 2.150%, 02/09/31	523 226	0,01
500 000 USD	NatWest Markets PLC, 1.600%, 29/09/26	456 970	0,01	645 000 USD	Royalty Pharma PLC, 3.350%, 02/09/51	439 200	0,01
100 000 EUR	NatWest Markets PLC, 1.375%, 02/03/27	103 965	0,00	100 000 GBP	Sanctuary Capital PLC, 5.000%, 26/04/47	126 312	0,00
150 000 GBP	Network Rail Infrastructure Finance PLC, 4.375%, 09/12/30	197 853	0,00	100 000 GBP	Santander UK Group Holdings PLC, 3.625%, 14/01/26	123 385	0,00
100 000 GBP	Northern Gas Networks Finance PLC, 6.125%, 02/06/33	138 006	0,00	1 000 000 USD	Santander UK Group Holdings PLC, 6.534%, 10/01/29	1 037 070	0,02
300 000 GBP	Northern Powergrid Northeast PLC, 1.875%, 16/06/62	200 115	0,00	100 000 GBP	Santander UK Group Holdings PLC, 2.421%, 17/01/29	113 869	0,00
200 000 GBP	Northumbrian Water Finance PLC, 4.500%, 14/02/31	245 684	0,01	100 000 EUR	Santander UK Group Holdings PLC, 0.603%, 13/09/29	95 022	0,00
100 000 GBP	Northumbrian Water Finance PLC, 5.125%, 23/01/42	121 388	0,00	100 000 GBP	Santander UK PLC, 5.750%, 02/03/26	130 077	0,00
100 000 GBP	Notting Hill Genesis, 4.375%, 20/02/54	113 670	0,00	600 000 EUR	Santander UK PLC, 1.125%, 12/03/27	626 489	0,01
300 000 GBP	Notting Hill Genesis, 2.000%, perpetual	278 076	0,01	100 000 GBP	Santander UK PLC, 5.250%, 16/02/29	134 449	0,00
100 000 EUR	Omnicom Finance Holdings PLC, 1.400%, 08/07/31	98 932	0,00	300 000 GBP	Scottish Hydro Electric Transmission PLC, 2.125%, 24/03/36	288 941	0,01
100 000 GBP	Onward Homes Ltd, 2.125%, 25/03/53	71 812	0,00	100 000 GBP	Segro PLC, 2.375%, 11/10/29	113 555	0,00
100 000 GBP	Orbit Capital PLC, 3.375%, 14/06/48	96 418	0,00	100 000 GBP	Severn Trent Utilities Finance PLC, 3.625%, 16/01/26	124 765	0,00
300 000 GBP	Peabody Capital No 2 Plc, 2.750%, 02/03/34	316 565	0,01	300 000 GBP	Severn Trent Utilities Finance PLC, 2.000%, 02/06/40	253 894	0,01
100 000 GBP	Peabody Capital No 2 Plc, 4.625%, 12/12/53	118 741	0,00	50 000 USD	Smith & Nephew PLC, 2.032%, 14/10/30	41 409	0,00
300 000 GBP	Pension Insurance Corp PLC, 4.625%, 07/05/31	339 335	0,01	100 000 EUR	Smiths Group PLC, 2.000%, 23/02/27	107 051	0,00
100 000 GBP	Pension Insurance Corp PLC, 8.000%, 13/11/33	136 587	0,00	50 000 GBP	South Eastern Power Networks PLC, 6.375%, 12/11/31	71 518	0,00
100 000 GBP	Places for People Homes Ltd, 3.625%, 22/11/28	120 544	0,00	100 000 GBP	Sovereign Housing Capital PLC, 2.375%, 04/11/48	80 943	0,00
300 000 GBP	Prs Finance PLC, 2.000%, 23/01/29	350 219	0,01	300 000 GBP	SP Transmission PLC, 2.000%, 13/11/31	325 965	0,01
500 000 USD	Prudential Funding Asia PLC, 2.950%, 03/11/33	439 110	0,01	100 000 EUR	SSE PLC, 1.250%, 16/04/25	107 247	0,00
200 000 USD	Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3.000%, 26/06/27	190 002	0,00	100 000 EUR	SSE PLC, 0.875%, 06/09/25	106 106	0,00
				150 000 GBP	SSE PLC, 8.375%, 20/11/28	224 073	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)				
100 000 EUR	SSE PLC, 1.750%, 16/04/30	101 315	0,00	15 000 USD	Vodafone Group PLC, 7.875%, 15/02/30	17 220	0,00	
200 000 EUR	SSE PLC, 4.000%, perpetual	214 242	0,00	400 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.625%, 24/11/30	400 754	0,01	
300 000 USD	Standard Chartered PLC, 2.819%, 30/01/26	290 193	0,01	225 000 USD	Vodafone Group PLC, 6.150%, 27/02/37	244 042	0,01	
500 000 USD	Standard Chartered PLC, 1.456%, 14/01/27	458 430	0,01	200 000 USD	Vodafone Group PLC, 4.375%, 19/02/43	174 984	0,00	
100 000 USD	Standard Chartered PLC, 4.300%, 19/02/27	95 638	0,00	150 000 USD	Vodafone Group PLC, 4.875%, 19/06/49	136 318	0,00	
100 000 EUR	Standard Chartered PLC, 1.625%, 03/10/27	104 714	0,00	100 000 GBP	Vodafone Group PLC, 3.375%, 08/08/49	92 052	0,00	
100 000 EUR	Standard Chartered PLC, 0.850%, 27/01/28	101 194	0,00	300 000 GBP	Vodafone Group PLC, 5.125%, 02/12/52	363 199	0,01	
500 000 USD	Standard Chartered PLC, 6.750%, 08/02/28	515 375	0,01	100 000 USD	Vodafone Group PLC, 5.125%, 19/06/59	91 514	0,00	
100 000 EUR	Standard Chartered PLC, 0.800%, 17/11/29	96 120	0,00	100 000 GBP	Wales & West Utilities Finance PLC, 3.000%, 03/08/38	99 906	0,00	
300 000 USD	Standard Chartered PLC, 4.866%, 15/03/33	282 282	0,01	100 000 GBP	Wellcome Trust Ltd, 4.000%, 09/05/59	120 508	0,00	
100 000 GBP	Standard Chartered PLC, 5.125%, 06/06/34	120 841	0,00	300 000 GBP	Wellcome Trust Ltd, 1.500%, 14/07/71	171 953	0,00	
500 000 EUR	Standard Chartered PLC, 4.874%, perpetual	577 997	0,01	100 000 GBP	Wessex Water Services Finance PLC, 5.125%, 31/10/32	127 340	0,00	
200 000 EUR	Swiss Re Finance Uk PLC, 2.714%, 04/06/52	195 861	0,00	200 000 GBP	Westfield Stratford City Finance NO 2 PLC, 1.642%, 04/08/26	231 425	0,00	
400 000 EUR	Tesco Corporate Treasury Services PLC, 0.375%, 27/07/29	375 453	0,01	300 000 EUR	Westpac Securities NZ Ltd, 1.099%, 24/03/26	314 404	0,01	
90 046 GBP	Tesco Property Finance 3 PLC, 5.744%, 13/04/40	116 158	0,00	100 000 EUR	Westpac Securities NZ Ltd, 0.100%, 13/07/27	98 826	0,00	
100 000 GBP	Thames Water Utilities Finance PLC, 3.500%, 25/02/28	114 875	0,00	100 000 GBP	Whitbread Group PLC, 2.375%, 31/05/27	116 132	0,00	
500 000 GBP	Thames Water Utilities Finance PLC, 2.375%, 22/04/40	390 809	0,01	100 000 EUR	Yorkshire Building Society, 0.500%, 01/07/28	96 682	0,00	
300 000 GBP	THFC Funding No 3 PLC, 5.200%, 11/10/43	390 333	0,01	200 000 GBP	Yorkshire Building Society, 6.375%, 15/11/28	259 919	0,01	
100 000 GBP	Transport for London, 3.625%, 15/05/45	105 941	0,00	100 000 GBP	Yorkshire Water Finance PLC, 1.750%, 26/11/26	115 587	0,00	
500 000 GBP	Unilever PLC, 1.500%, 22/07/26	600 692	0,01	100 000 GBP	Yorkshire Water Finance PLC, 1.750%, 27/10/32	95 852	0,00	
100 000 GBP	United Utilities Water Finance PLC, 2.000%, 14/02/25	123 047	0,00					
100 000 GBP	United Utilities Water Finance PLC, 0.875%, 28/10/29	103 758	0,00					
100 000 GBP	University of Leeds, 3.125%, 19/12/50	99 473	0,00	Royaume-Uni – Total			80 129 003	1,20
100 000 GBP	University of Oxford, 2.544%, 08/12/17	74 777	0,00	États-Unis				
100 000 GBP	Virgin Money UK PLC, 4.000%, 03/09/27	121 035	0,00	500 000 USD	7-Eleven Inc, 0.950%, 10/02/26	462 405	0,01	
300 000 GBP	Virgin Money UK PLC, 2.625%, 19/08/31	338 280	0,01	300 000 USD	7-Eleven Inc, 2.500%, 10/02/41	206 934	0,00	
100 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.875%, 11/09/25	107 676	0,00	150 000 USD	Abbott Laboratories, 2.950%, 15/03/25	146 934	0,00	
100 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.125%, 20/11/25	106 339	0,00	140 000 USD	Abbott Laboratories, 3.875%, 15/09/25	138 634	0,00	
100 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.200%, 25/08/26	108 372	0,00	85 000 USD	Abbott Laboratories, 3.750%, 30/11/26	83 800	0,00	
100 000 EUR	Vodafone Group PLC, 0.900%, 24/11/26	104 727	0,00	545 000 USD	Abbott Laboratories, 1.150%, 30/01/28	486 265	0,01	
				40 000 USD	Abbott Laboratories, 1.400%, 30/06/30	33 904	0,00	
				100 000 USD	Abbott Laboratories, 4.750%, 30/11/36	102 534	0,00	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
17 000 USD	Abbott Laboratories, 6.150%, 30/11/37	19 599	0,00	500 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 5.150%, 15/04/53	484 740	0,01
100 000 USD	Abbott Laboratories, 5.300%, 27/05/40	108 790	0,00	95 000 USD	Alleghany Corp, 4.900%, 15/09/44	92 562	0,00
1 140 000 USD	AbbVie Inc, 3.800%, 15/03/25	1 125 739	0,02	50 000 USD	Allegion US Holding Co Inc, 3.550%, 01/10/27	47 493	0,00
175 000 USD	AbbVie Inc, 3.600%, 14/05/25	171 881	0,00	500 000 USD	Allegion US Holding Co Inc, 5.411%, 01/07/32	513 380	0,01
100 000 USD	AbbVie Inc, 3.200%, 14/05/26	96 929	0,00	500 000 USD	Alliant Energy Finance LLC, 5.950%, 30/03/29	520 395	0,01
105 000 USD	AbbVie Inc, 2.950%, 21/11/26	100 721	0,00	95 000 USD	Allstate Corp, 0.750%, 15/12/25	87 624	0,00
50 000 USD	AbbVie Inc, 4.250%, 14/11/28	49 780	0,00	150 000 USD	Allstate Corp, 1.450%, 15/12/30	121 493	0,00
100 000 EUR	AbbVie Inc, 2.625%, 15/11/28	108 632	0,00	15 000 USD	Allstate Corp, 5.550%, 09/05/35	15 607	0,00
545 000 USD	AbbVie Inc, 3.200%, 21/11/29	509 733	0,01	150 000 USD	Allstate Corp, 3.850%, 10/08/49	121 540	0,00
170 000 USD	AbbVie Inc, 4.550%, 15/03/35	166 989	0,00	250 000 USD	Ally Financial Inc, 5.800%, 01/05/25	250 200	0,00
60 000 USD	AbbVie Inc, 4.500%, 14/05/35	58 744	0,00	500 000 USD	Ally Financial Inc, 4.750%, 09/06/27	483 330	0,01
150 000 USD	AbbVie Inc, 4.300%, 14/05/36	144 022	0,00	500 000 USD	Ally Financial Inc, 7.100%, 15/11/27	521 410	0,01
605 000 USD	AbbVie Inc, 4.050%, 21/11/39	548 063	0,01	300 000 USD	Alphabet Inc, 1.998%, 15/08/26	283 491	0,00
150 000 USD	AbbVie Inc, 4.400%, 06/11/42	139 536	0,00	325 000 USD	Alphabet Inc, 1.100%, 15/08/30	269 906	0,00
180 000 USD	AbbVie Inc, 4.750%, 15/03/45	173 515	0,00	100 000 EUR	Altria Group Inc, 1.700%, 15/06/25	107 363	0,00
100 000 USD	AbbVie Inc, 4.450%, 14/05/46	91 984	0,00	26 000 USD	Altria Group Inc, 4.400%, 14/02/26	25 766	0,00
75 000 USD	AbbVie Inc, 4.875%, 14/11/48	73 452	0,00	100 000 USD	Altria Group Inc, 2.625%, 16/09/26	94 572	0,00
190 000 USD	AbbVie Inc, 4.250%, 21/11/49	169 828	0,00	500 000 EUR	Altria Group Inc, 2.200%, 15/06/27	531 950	0,01
60 000 USD	Adobe Inc, 3.250%, 01/02/25	58 982	0,00	255 000 USD	Altria Group Inc, 4.800%, 14/02/29	254 668	0,00
500 000 USD	Advanced Micro Devices Inc, 4.393%, 01/06/52	474 880	0,01	50 000 USD	Altria Group Inc, 3.400%, 06/05/30	45 715	0,00
500 000 USD	Adventist Health System/West, 5.430%, 01/03/32	509 550	0,01	100 000 EUR	Altria Group Inc, 3.125%, 15/06/31	100 303	0,00
100 000 USD	Advocate Health & Hospitals Corp, 3.387%, 15/10/49	76 708	0,00	65 000 USD	Altria Group Inc, 5.800%, 14/02/39	66 461	0,00
15 000 USD	Aetna Inc, 6.750%, 15/12/37	16 885	0,00	100 000 USD	Altria Group Inc, 3.875%, 16/09/46	75 441	0,00
30 000 USD	Aetna Inc, 3.875%, 15/08/47	23 556	0,00	275 000 USD	Altria Group Inc, 5.950%, 14/02/49	280 780	0,00
50 000 USD	Affiliated Managers Group Inc, 3.500%, 01/08/25	48 487	0,00	500 000 USD	Altria Group Inc, 4.000%, 04/02/61	366 775	0,01
540 000 USD	Aflac Inc, 1.125%, 15/03/26	498 695	0,01	635 000 USD	Amazon.com Inc, 0.800%, 03/06/25	601 758	0,01
220 000 USD	Aflac Inc, 3.600%, 01/04/30	208 283	0,00	500 000 USD	Amazon.com Inc, 4.600%, 01/12/25	501 740	0,01
50 000 USD	Agilent Technologies Inc, 2.750%, 15/09/29	45 801	0,00	650 000 USD	Amazon.com Inc, 1.000%, 12/05/26	601 042	0,01
415 000 USD	Agilent Technologies Inc, 2.100%, 04/06/30	357 614	0,01	1 000 000 USD	Amazon.com Inc, 3.300%, 13/04/27	971 500	0,02
565 000 USD	Agree LP, 2.000%, 15/06/28	490 686	0,01	500 000 USD	Amazon.com Inc, 1.200%, 03/06/27	451 520	0,01
375 000 USD	AHS Hospital Corp, 2.780%, 01/07/51	248 719	0,00	200 000 USD	Amazon.com Inc, 3.150%, 22/08/27	192 438	0,00
100 000 USD	Air Lease Corp, 2.300%, 01/02/25	96 499	0,00	450 000 USD	Amazon.com Inc, 1.650%, 12/05/28	405 526	0,01
120 000 USD	Air Lease Corp, 2.875%, 15/01/26	114 406	0,00	665 000 USD	Amazon.com Inc, 1.500%, 03/06/30	563 873	0,01
200 000 USD	Air Lease Corp, 3.750%, 01/06/26	193 190	0,00	650 000 USD	Amazon.com Inc, 2.100%, 12/05/31	560 638	0,01
550 000 USD	Air Lease Corp, 1.875%, 15/08/26	506 418	0,01	500 000 USD	Amazon.com Inc, 3.600%, 13/04/32	476 340	0,01
100 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 2.750%, 15/12/29	87 683	0,00	500 000 USD	Amazon.com Inc, 4.700%, 01/12/32	514 370	0,01
90 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 3.375%, 15/08/31	81 268	0,00	200 000 USD	Amazon.com Inc, 4.800%, 05/12/34	207 274	0,00
350 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 1.875%, 01/02/33	272 951	0,00				
200 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 2.950%, 15/03/34	167 156	0,00				
150 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 4.000%, 01/02/50	119 006	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
145 000 USD	Amazon.com Inc, 3.875%, 22/08/37	134 864	0,00	100 000 USD	American Tower Corp, 2.950%, 15/01/25	97 564	0,00
650 000 USD	Amazon.com Inc, 2.875%, 12/05/41	511 082	0,01	500 000 USD	American Tower Corp, 1.600%, 15/04/26	462 485	0,01
145 000 USD	Amazon.com Inc, 4.050%, 22/08/47	130 994	0,00	500 000 USD	American Tower Corp, 1.450%, 15/09/26	456 015	0,01
650 000 USD	Amazon.com Inc, 3.100%, 12/05/51	485 504	0,01	100 000 EUR	American Tower Corp, 0.450%, 15/01/27	101 029	0,00
270 000 USD	Amazon.com Inc, 4.250%, 22/08/57	249 604	0,00	160 000 EUR	American Tower Corp, 0.500%, 15/01/28	157 624	0,00
650 000 USD	Amazon.com Inc, 3.250%, 12/05/61	479 700	0,01	500 000 USD	American Tower Corp, 5.500%, 15/03/28	511 980	0,01
630 000 USD	Ancor Flexibles North America Inc, 2.690%, 25/05/31	544 780	0,01	150 000 USD	American Tower Corp, 3.950%, 15/03/29	143 482	0,00
66 689 USD	American Airlines 2016-1 Class AA Pass Through Trust, 3.575%, 15/01/28	61 874	0,00	100 000 EUR	American Tower Corp, 0.875%, 21/05/29	96 296	0,00
16 203 USD	American Airlines 2019-1 Class AA Pass Through Trust, 3.150%, 15/02/32	14 259	0,00	265 000 USD	American Tower Corp, 3.800%, 15/08/29	251 806	0,00
300 000 USD	American Express Co, 2.250%, 04/03/25	290 310	0,01	200 000 USD	American Tower Corp, 2.900%, 15/01/30	178 890	0,00
500 000 USD	American Express Co, 3.950%, 01/08/25	492 050	0,01	500 000 USD	American Tower Corp, 2.300%, 15/09/31	414 770	0,01
500 000 USD	American Express Co, 4.900%, 13/02/26	501 385	0,01	130 000 EUR	American Tower Corp, 1.000%, 15/01/32	117 486	0,00
500 000 USD	American Express Co, 4.990%, 01/05/26	498 855	0,01	100 000 EUR	American Tower Corp, 1.250%, 21/05/33	88 930	0,00
500 000 USD	American Express Co, 1.650%, 04/11/26	459 910	0,01	500 000 USD	American Tower Corp, 3.100%, 15/06/50	342 415	0,01
500 000 USD	American Express Co, 2.550%, 04/03/27	468 725	0,01	135 000 USD	American Water Capital Corp, 2.950%, 01/09/27	127 714	0,00
300 000 USD	American Express Co, 3.300%, 03/05/27	286 959	0,01	600 000 USD	American Water Capital Corp, 2.300%, 01/06/31	512 340	0,01
1 000 000 USD	American Express Co, 5.625%, 28/07/34	1 036 610	0,02	100 000 USD	American Water Capital Corp, 4.000%, 01/12/46	84 031	0,00
550 000 USD	American Express Co, 4.050%, 03/12/42	497 931	0,01	50 000 USD	American Water Capital Corp, 3.750%, 01/09/47	40 969	0,00
150 000 USD	American Financial Group Inc, 4.500%, 15/06/47	126 231	0,00	600 000 USD	American Water Capital Corp, 3.250%, 01/06/51	443 712	0,01
500 000 USD	American Homes 4 Rent LP, 4.300%, 15/04/52	406 175	0,01	365 000 USD	Amgen Inc, 1.900%, 21/02/25	352 579	0,01
1 000 000 USD	American Honda Finance Corp, 5.800%, 03/10/25	1 017 900	0,02	1 000 000 USD	Amgen Inc, 5.150%, 02/03/28	1 023 210	0,02
500 000 USD	American Honda Finance Corp, 1.300%, 09/09/26	459 720	0,01	100 000 GBP	Amgen Inc, 4.000%, 13/09/29	125 573	0,00
100 000 GBP	American Honda Finance Corp, 0.750%, 25/11/26	115 216	0,00	100 000 USD	Amgen Inc, 2.450%, 21/02/30	88 798	0,00
100 000 EUR	American Honda Finance Corp, 0.300%, 07/07/28	97 795	0,00	350 000 USD	Amgen Inc, 3.150%, 21/02/40	272 835	0,00
1 000 000 USD	American Honda Finance Corp, 5.125%, 07/07/28	1 028 430	0,02	600 000 USD	Amgen Inc, 2.800%, 15/08/41	437 010	0,01
1 000 000 USD	American Honda Finance Corp, 4.600%, 17/04/30	1 001 520	0,02	1 000 000 USD	Amgen Inc, 5.600%, 02/03/43	1 035 270	0,02
300 000 GBP	American Honda Finance Corp, 5.600%, 06/09/30	406 407	0,01	100 000 USD	Amgen Inc, 4.563%, 15/06/48	90 497	0,00
1 000 000 USD	American Honda Finance Corp, 5.850%, 04/10/30	1 068 690	0,02	100 000 USD	Amgen Inc, 3.375%, 21/02/50	74 675	0,00
				300 000 USD	Amgen Inc, 4.663%, 15/06/51	274 005	0,00
				500 000 USD	Amgen Inc, 5.650%, 02/03/53	528 140	0,01
				657 000 USD	Amgen Inc, 2.770%, 01/09/53	423 016	0,01
				500 000 USD	Amgen Inc, 5.750%, 02/03/63	527 125	0,01
				300 000 USD	Amphenol Corp, 2.050%, 01/03/25	289 704	0,01
				150 000 USD	Amphenol Corp, 2.800%, 15/02/30	136 858	0,00
				100 000 USD	Analog Devices Inc, 3.450%, 15/06/27	96 986	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
500 000 USD	Analog Devices Inc, 2.800%, 01/10/41	374 475	0,01	200 000 USD	Apple Inc, 1.650%, 08/02/31	168 782	0,00
250 000 USD	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3.650%, 01/02/26	245 407	0,00	300 000 EUR	Apple Inc, 0.500%, 15/11/31	282 339	0,00
100 000 USD	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.700%, 01/02/36	99 921	0,00	1 600 000 USD	Apple Inc, 2.375%, 08/02/41	1 175 184	0,02
335 000 USD	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.900%, 01/02/46	329 744	0,01	100 000 GBP	Apple Inc, 3.600%, 31/07/42	115 841	0,00
80 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.000%, 13/04/28	79 110	0,00	150 000 USD	Apple Inc, 3.450%, 09/02/45	125 364	0,00
85 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.750%, 23/01/29	86 448	0,00	100 000 USD	Apple Inc, 4.650%, 23/02/46	98 829	0,00
300 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3.500%, 01/06/30	286 149	0,00	135 000 USD	Apple Inc, 3.850%, 04/08/46	117 925	0,00
65 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.900%, 23/01/31	67 696	0,00	215 000 USD	Apple Inc, 4.250%, 09/02/47	203 637	0,00
535 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.375%, 15/04/38	508 544	0,01	65 000 USD	Apple Inc, 2.950%, 11/09/49	47 922	0,00
200 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 8.200%, 15/01/39	267 634	0,00	500 000 USD	Apple Inc, 2.650%, 11/05/50	345 170	0,01
500 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.350%, 01/06/40	468 010	0,01	200 000 USD	Apple Inc, 2.650%, 08/02/51	137 310	0,00
1 100 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.950%, 15/01/42	1 104 356	0,02	1 000 000 USD	Apple Inc, 4.850%, 10/05/53	1 022 040	0,02
35 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.600%, 15/04/48	33 174	0,00	100 000 USD	Applied Materials Inc, 3.300%, 01/04/27	96 945	0,00
133 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.439%, 06/10/48	122 917	0,00	200 000 USD	Applied Materials Inc, 5.850%, 15/06/41	222 106	0,00
350 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5.550%, 23/01/49	377 401	0,01	100 000 EUR	Archer-Daniels-Midland Co, 1.000%, 12/09/25	106 454	0,00
245 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5.800%, 23/01/59	275 542	0,00	300 000 USD	Archer-Daniels-Midland Co, 2.700%, 15/09/51	203 421	0,00
1 000 000 USD	Antares Holdings LP, 7.950%, 11/08/28	1 035 080	0,02	500 000 USD	Ares Management Corp, 6.375%, 10/11/28	524 685	0,01
300 000 USD	Aon Corp, 3.750%, 02/05/29	287 355	0,01	500 000 USD	Arthur J Gallagher & Co, 3.050%, 09/03/52	336 605	0,01
300 000 USD	Aon Corp / Aon Global Holdings PLC, 2.900%, 23/08/51	196 539	0,00	300 000 USD	Ascension Health, 3.106%, 15/11/39	236 808	0,00
200 000 USD	Apollo Management Holdings LP, 4.872%, 15/02/29	196 662	0,00	50 000 USD	Ascension Health, 3.945%, 15/11/46	43 209	0,00
300 000 USD	Apple Inc, 2.750%, 13/01/25	293 967	0,01	300 000 USD	Ashtead Capital Inc, 4.375%, 15/08/27	288 201	0,01
200 000 USD	Apple Inc, 3.200%, 13/05/25	196 072	0,00	535 000 USD	Astrazeneca Finance LLC, 1.200%, 28/05/26	495 373	0,01
100 000 EUR	Apple Inc, 0.875%, 24/05/25	107 032	0,00	520 000 USD	Astrazeneca Finance LLC, 2.250%, 28/05/31	449 270	0,01
300 000 EUR	Apple Inc, 0.010%, 15/11/25	314 209	0,01	1 000 000 USD	AT&T Inc, 5.539%, 20/02/26	1 000 710	0,02
200 000 USD	Apple Inc, 0.700%, 08/02/26	185 316	0,00	500 000 EUR	AT&T Inc, 0.250%, 04/03/26	518 506	0,01
300 000 USD	Apple Inc, 3.250%, 23/02/26	292 908	0,01	900 000 USD	AT&T Inc, 1.700%, 25/03/26	842 013	0,01
400 000 USD	Apple Inc, 2.450%, 04/08/26	381 676	0,01	100 000 USD	AT&T Inc, 4.250%, 01/03/27	98 984	0,00
1 300 000 USD	Apple Inc, 2.050%, 11/09/26	1 226 316	0,02	185 000 USD	AT&T Inc, 1.650%, 01/02/28	164 890	0,00
500 000 USD	Apple Inc, 3.200%, 11/05/27	484 520	0,01	14 000 USD	AT&T Inc, 4.100%, 15/02/28	13 697	0,00
140 000 USD	Apple Inc, 3.000%, 20/06/27	134 711	0,00	500 000 EUR	AT&T Inc, 1.600%, 19/05/28	518 418	0,01
100 000 USD	Apple Inc, 2.900%, 12/09/27	95 810	0,00	200 000 USD	AT&T Inc, 4.350%, 01/03/29	197 498	0,00
100 000 EUR	Apple Inc, 1.375%, 24/05/29	103 789	0,00	200 000 EUR	AT&T Inc, 2.350%, 05/09/29	211 719	0,00
200 000 USD	Apple Inc, 2.200%, 11/09/29	181 196	0,00	200 000 GBP	AT&T Inc, 4.375%, 14/09/29	251 612	0,00
500 000 USD	Apple Inc, 1.650%, 11/05/30	428 310	0,01	100 000 EUR	AT&T Inc, 2.600%, 17/12/29	106 502	0,00
				152 000 USD	AT&T Inc, 4.300%, 15/02/30	148 925	0,00
				200 000 USD	AT&T Inc, 2.750%, 01/06/31	175 482	0,00
				335 000 USD	AT&T Inc, 2.250%, 01/02/32	277 152	0,00
				300 000 GBP	AT&T Inc, 5.200%, 18/11/33	390 479	0,01
				500 000 USD	AT&T Inc, 2.550%, 01/12/33	407 820	0,01
				195 000 USD	AT&T Inc, 4.500%, 15/05/35	184 983	0,00
				100 000 EUR	AT&T Inc, 3.150%, 04/09/36	102 882	0,00
				200 000 USD	AT&T Inc, 5.250%, 01/03/37	201 360	0,00
				300 000 USD	AT&T Inc, 4.900%, 15/08/37	290 889	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 EUR	AT&T Inc, 2.600%, 19/05/38	94 764	0,00	1 300 000 USD	Avista Corp, 4.000%, 01/04/52	1 039 129	0,02
250 000 USD	AT&T Inc, 4.850%, 01/03/39	239 290	0,00	500 000 USD	Avnet Inc, 6.250%, 15/03/28	518 360	0,01
500 000 USD	AT&T Inc, 3.500%, 01/06/41	397 980	0,01	100 000 USD	Avnet Inc, 5.500%, 01/06/32	99 405	0,00
500 000 USD	AT&T Inc, 3.100%, 01/02/43	377 805	0,01	300 000 USD	AXIS Specialty Finance LLC, 4.900%, 15/01/40	249 681	0,00
100 000 GBP	AT&T Inc, 4.250%, 01/06/43	110 345	0,00	250 000 USD	Baker Hughes Holdings LLC, 5.125%, 15/09/40	253 695	0,00
126 000 USD	AT&T Inc, 4.350%, 15/06/45	109 275	0,00	100 000 USD	Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc, 3.337%, 15/12/27	95 746	0,00
185 000 USD	AT&T Inc, 4.750%, 15/05/46	168 132	0,00	300 000 USD	Baker Hughes Holdings LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc, 4.080%, 15/12/47	255 189	0,00
100 000 USD	AT&T Inc, 4.550%, 09/03/49	87 843	0,00	100 000 USD	Baltimore Gas and Electric Co, 3.750%, 15/08/47	80 048	0,00
200 000 USD	AT&T Inc, 3.650%, 01/06/51	151 058	0,00	700 000 USD	Baltimore Gas and Electric Co, 2.250%, perpetual	598 038	0,01
632 000 USD	AT&T Inc, 3.500%, 15/09/53	460 665	0,01	100 000 EUR	Bank of America Corp, 1.375%, 26/03/25	107 712	0,00
675 000 USD	AT&T Inc, 3.550%, 15/09/55	487 708	0,01	100 000 GBP	Bank of America Corp, 2.300%, 25/07/25	122 320	0,00
697 000 USD	AT&T Inc, 3.800%, 01/12/57	520 122	0,01	100 000 USD	Bank of America Corp, 3.875%, 01/08/25	98 617	0,00
382 000 USD	AT&T Inc, 3.650%, 15/09/59	274 799	0,00	200 000 USD	Bank of America Corp, 2.015%, 13/02/26	192 148	0,00
500 000 EUR	AT&T Inc, 3.950%, perpetual	572 976	0,01	100 000 USD	Bank of America Corp, 4.450%, 03/03/26	98 879	0,00
500 000 USD	Athene Global Funding, 1.716%, 07/01/25	479 140	0,01	200 000 EUR	Bank of America Corp, 0.808%, 09/05/26	212 327	0,00
100 000 EUR	Athene Global Funding, 0.366%, 10/09/26	101 122	0,00	500 000 USD	Bank of America Corp, 1.319%, 19/06/26	470 605	0,01
100 000 EUR	Athene Global Funding, 0.832%, 08/01/27	102 037	0,00	250 000 USD	Bank of America Corp, 1.197%, 24/10/26	232 092	0,00
100 000 EUR	Athene Global Funding, 0.625%, 12/01/28	98 293	0,00	500 000 EUR	Bank of America Corp, 1.949%, 27/10/26	536 247	0,01
200 000 USD	Atmos Energy Corp, 1.500%, 15/01/31	163 088	0,00	1 250 000 USD	Bank of America Corp, 1.658%, 11/03/27	1 156 675	0,02
1 000 000 USD	Atmos Energy Corp, 5.900%, 15/11/33	1 087 080	0,02	200 000 USD	Bank of America Corp, 3.559%, 23/04/27	192 616	0,00
120 000 USD	Atmos Energy Corp, 5.500%, 15/06/41	125 815	0,00	1 320 000 USD	Bank of America Corp, 1.734%, 22/07/27	1 209 463	0,02
20 000 USD	Atmos Energy Corp, 4.125%, 15/03/49	17 365	0,00	150 000 USD	Bank of America Corp, 3.248%, 21/10/27	142 891	0,00
600 000 USD	Atmos Energy Corp, 2.850%, 15/02/52	410 346	0,01	200 000 USD	Bank of America Corp, 3.824%, 20/01/28	192 396	0,00
500 000 USD	Atmos Energy Corp, 5.750%, 15/10/52	551 760	0,01	500 000 CAD	Bank of America Corp, 3.615%, 16/03/28	367 382	0,01
205 000 USD	Autodesk Inc, 2.850%, 15/01/30	185 066	0,00	200 000 USD	Bank of America Corp, 3.705%, 24/04/28	191 204	0,00
225 000 USD	Automatic Data Processing Inc, 3.375%, 15/09/25	220 637	0,00	100 000 EUR	Bank of America Corp, 1.662%, 25/04/28	104 395	0,00
500 000 USD	Automatic Data Processing Inc, 1.700%, 15/05/28	451 885	0,01	143 000 EUR	Bank of America Corp, 4.134%, 12/06/28	162 905	0,00
40 000 USD	Automatic Data Processing Inc, 1.250%, 01/09/30	33 263	0,00	400 000 USD	Bank of America Corp, 3.593%, 21/07/28	379 808	0,01
300 000 USD	AutoNation Inc, 3.850%, 01/03/32	267 522	0,00	300 000 EUR	Bank of America Corp, 0.583%, 24/08/28	298 653	0,01
100 000 USD	AutoZone Inc, 3.750%, 01/06/27	97 196	0,00				
210 000 USD	AutoZone Inc, 1.650%, 15/01/31	171 032	0,00				
1 000 000 USD	AutoZone Inc, 4.750%, 01/02/33	987 200	0,02				
65 000 USD	AvalonBay Communities Inc, 3.300%, 01/06/29	60 785	0,00				
20 000 USD	AvalonBay Communities Inc, 2.300%, 01/03/30	17 458	0,00				
140 000 USD	AvalonBay Communities Inc, 2.450%, 15/01/31	121 122	0,00				
100 000 USD	AvalonBay Communities Inc, 4.150%, 01/07/47	84 252	0,00				
1 000 000 USD	Avangrid Inc, 3.200%, 15/04/25	972 330	0,02				
250 000 USD	Avangrid Inc, 3.800%, 01/06/29	235 495	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
500 000 USD	Bank of America Corp, 5.202%, 25/04/29	503 485	0,01	300 000 GBP	Bank Of America Corp, 1.667%, 02/06/29	335 973	0,01
175 000 USD	Bank of America Corp, 3.974%, 07/02/30	166 043	0,00	700 000 USD	BANK OF AMERICA CORP, 2.551%, 04/02/28	649 061	0,01
100 000 USD	Bank of America Corp, 3.194%, 23/07/30	90 782	0,00	125 000 USD	BANK OF AMERICA CORP, 2.972%, 04/02/33	106 363	0,00
300 000 USD	Bank of America Corp, 2.884%, 22/10/30	266 676	0,00	1 000 000 USD	Bank of America NA, 5.650%, 18/08/25	1 012 880	0,02
200 000 USD	Bank of America Corp, 2.496%, 13/02/31	171 968	0,00	100 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 3.000%, 24/02/25	97 811	0,00
100 000 EUR	Bank of America Corp, 0.694%, 22/03/31	92 308	0,00	200 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 0.750%, 28/01/26	184 378	0,00
500 000 USD	Bank of America Corp, 1.898%, 23/07/31	408 735	0,01	500 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 4.947%, 26/04/27	500 200	0,01
250 000 USD	Bank of America Corp, 1.922%, 24/10/31	203 335	0,00	150 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 3.250%, 16/05/27	143 874	0,00
100 000 EUR	Bank of America Corp, 0.654%, 26/10/31	90 475	0,00	350 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 3.850%, 28/04/28	341 526	0,01
250 000 USD	Bank of America Corp, 2.651%, 11/03/32	211 217	0,00	600 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 1.650%, 14/07/28	528 420	0,01
500 000 USD	Bank of America Corp, 2.687%, 22/04/32	422 540	0,01	500 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 4.543%, 01/02/29	497 205	0,01
100 000 EUR	Bank of America Corp, 1.102%, 24/05/32	92 051	0,00	200 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 3.300%, 23/08/29	187 458	0,00
500 000 USD	Bank of America Corp, 2.299%, 21/07/32	408 920	0,01	200 000 USD	BankUnited Inc, 5.125%, 11/06/30	183 520	0,00
500 000 USD	Bank of America Corp, 2.572%, 20/10/32	415 365	0,01	500 000 USD	Banner Health, 2.907%, 01/01/42	368 065	0,01
100 000 EUR	Bank of America Corp, 2.824%, 27/04/33	103 645	0,00	100 000 GBP	BAT Capital Corp, 2.125%, 15/08/25	121 130	0,00
1 500 000 USD	Bank of America Corp, 5.288%, 25/04/34	1 504 545	0,02	150 000 USD	BAT Capital Corp, 3.557%, 15/08/27	143 503	0,00
500 000 USD	Bank of America Corp, 5.872%, 15/09/34	524 635	0,01	150 000 USD	BAT Capital Corp, 2.259%, 25/03/28	134 346	0,00
200 000 USD	Bank of America Corp, 6.110%, 29/01/37	214 002	0,00	300 000 USD	BAT Capital Corp, 2.726%, 25/03/31	251 865	0,00
200 000 USD	Bank of America Corp, 3.846%, 08/03/37	175 768	0,00	270 000 USD	BAT Capital Corp, 4.390%, 15/08/37	226 687	0,00
300 000 USD	Bank of America Corp, 4.244%, 24/04/38	271 080	0,00	1 000 000 USD	BAT Capital Corp, 7.079%, 02/08/43	1 064 550	0,02
1 500 000 USD	Bank of America Corp, 2.676%, 19/06/41	1 077 135	0,02	60 000 USD	BAT Capital Corp, 4.540%, 15/08/47	46 161	0,00
130 000 USD	Bank of America Corp, 5.875%, 07/02/42	140 569	0,00	500 000 USD	Baxter International Inc, 2.272%, 01/12/28	447 910	0,01
200 000 USD	Bank of America Corp, 3.311%, 22/04/42	156 600	0,00	400 000 EUR	Baxter International Inc, 1.300%, 15/05/29	396 596	0,01
200 000 USD	Bank of America Corp, 4.875%, 01/04/44	195 090	0,00	585 000 USD	Baxter International Inc, 1.730%, 01/04/31	476 354	0,01
200 000 USD	Bank of America Corp, 4.443%, 20/01/48	180 260	0,00	520 000 USD	Baylor Scott & White Holdings, 1.777%, 15/11/30	430 440	0,01
150 000 USD	Bank of America Corp, 4.330%, 15/03/50	131 992	0,00	125 000 USD	Becton Dickinson & Co, 4.669%, 06/06/47	116 900	0,00
75 000 USD	Bank of America Corp, 2.831%, 24/10/51	50 982	0,00	100 000 EUR	Berkshire Hathaway Finance Corp, 1.500%, 18/03/30	100 176	0,00
250 000 USD	Bank of America Corp, 3.483%, 13/03/52	193 702	0,00	40 000 USD	Berkshire Hathaway Finance Corp, 1.450%, 15/10/30	33 775	0,00
500 000 USD	Bank of America Corp, 2.972%, 21/07/52	353 340	0,01	300 000 USD	Berkshire Hathaway Finance Corp, 2.875%, 15/03/32	270 873	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 EUR	Berkshire Hathaway Finance Corp, 2.000%, 18/03/34	98 095	0,00	500 000 USD	Blue Owl Credit Income Corp, 4.700%, 08/02/27	473 190	0,01
100 000 GBP	Berkshire Hathaway Finance Corp, 2.375%, 19/06/39	95 061	0,00	200 000 USD	BLUE Owl Finance LLC, 4.375%, perpetual	174 932	0,00
300 000 USD	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4.200%, 15/08/48	277 443	0,00	1 000 000 USD	BMW US Capital LLC, 5.300%, 11/08/25	1 009 070	0,02
325 000 USD	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4.250%, 15/01/49	304 239	0,01	500 000 USD	BMW US Capital LLC, 1.250%, 12/08/26	458 645	0,01
45 000 USD	Berkshire Hathaway Finance Corp, 2.850%, 15/10/50	31 657	0,00	300 000 USD	BMW US Capital LLC, 3.300%, 06/04/27	288 066	0,01
355 000 USD	Berkshire Hathaway Finance Corp, 2.500%, 15/01/51	232 706	0,00	100 000 USD	Boardwalk Pipelines LP, 5.950%, 01/06/26	101 387	0,00
100 000 GBP	Berkshire Hathaway Finance Corp, 2.625%, 19/06/59	81 591	0,00	20 000 USD	Boardwalk Pipelines LP, 4.800%, 03/05/29	19 616	0,00
70 000 USD	Berkshire Hathaway Inc, 3.125%, 15/03/26	68 063	0,00	105 000 USD	Boardwalk Pipelines LP, 3.400%, 15/02/31	94 130	0,00
100 000 EUR	Berkshire Hathaway Inc, 1.125%, 16/03/27	104 122	0,00	500 000 EUR	Booking Holdings Inc, 0.100%, 08/03/25	530 784	0,01
200 000 EUR	Berkshire Hathaway Inc, 2.150%, 15/03/28	214 824	0,00	250 000 USD	Booking Holdings Inc, 3.600%, 01/06/26	244 410	0,00
100 000 EUR	Berkshire Hathaway Inc, 0.500%, 15/01/41	68 517	0,00	100 000 EUR	Booking Holdings Inc, 1.800%, 03/03/27	106 347	0,00
100 000 USD	Berkshire Hathaway Inc, 4.500%, 11/02/43	97 706	0,00	100 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.500%, 15/11/31	120 244	0,00
750 000 USD	Berry Global Inc, 1.570%, 15/01/26	697 477	0,01	500 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.125%, 12/05/33	589 403	0,01
500 000 USD	Berry Global Inc, 5.500%, 15/04/28	506 590	0,01	500 000 USD	Booz Allen Hamilton Inc, 5.950%, 04/08/33	528 720	0,01
50 000 USD	Best Buy Co Inc, 4.450%, 01/10/28	49 776	0,00	550 000 USD	BorgWarner Inc, 2.650%, 01/07/27	510 130	0,01
500 000 USD	Bimbo Bakeries USA Inc, 4.000%, 17/05/51	396 410	0,01	800 000 USD	Boston Gas Co, 3.757%, 16/03/32	711 904	0,01
30 000 USD	Biogen Inc, 4.050%, 15/09/25	29 519	0,00	200 000 USD	Boston Properties LP, 3.650%, 01/02/26	192 700	0,00
333 000 USD	Biogen Inc, 3.250%, 15/02/51	239 197	0,00	300 000 USD	Boston Properties LP, 2.750%, 01/10/26	278 595	0,00
500 000 USD	Bio-Rad Laboratories Inc, 3.300%, 15/03/27	475 355	0,01	500 000 USD	Boston Properties LP, 6.750%, 01/12/27	524 260	0,01
260 000 USD	BlackRock Inc, 3.250%, 30/04/29	250 268	0,00	200 000 USD	Boston Properties LP, 3.400%, 21/06/29	179 794	0,00
100 000 EUR	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 1.500%, 10/04/29	99 972	0,00	350 000 USD	Boston Properties LP, 2.450%, 01/10/33	266 959	0,00
400 000 EUR	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 3.500%, 01/06/34	427 354	0,01	30 000 USD	Boston Scientific Corp, 1.900%, 01/06/25	28 734	0,00
100 000 USD	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 5.000%, 15/06/44	92 301	0,00	100 000 EUR	Boston Scientific Corp, 0.625%, 01/12/27	100 945	0,00
500 000 USD	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 3.200%, 30/01/52	346 380	0,01	50 000 USD	Boston Scientific Corp, 2.650%, 01/06/30	44 730	0,00
500 000 USD	Blackstone Private Credit Fund, 2.625%, 15/12/26	452 485	0,01	100 000 USD	Boston Scientific Corp, 4.550%, 01/03/39	95 637	0,00
500 000 USD	Blackstone Private Credit Fund, 3.250%, 15/03/27	458 610	0,01	70 000 USD	Boston Scientific Corp, 4.700%, 01/03/49	67 530	0,00
75 000 USD	Block Financial LLC, 3.875%, 15/08/30	68 723	0,00	250 000 USD	BP Capital Markets America Inc, 3.410%, 11/02/26	244 247	0,00
100 000 USD	Blue Owl Capital Corp, 3.750%, 22/07/25	95 640	0,00	100 000 USD	BP Capital Markets America Inc, 3.017%, 16/01/27	95 849	0,00
100 000 USD	Blue Owl Capital Corp, 3.400%, 15/07/26	93 053	0,00	325 000 USD	BP Capital Markets America Inc, 1.749%, 10/08/30	275 775	0,00
600 000 USD	Blue Owl Capital Corp, 2.875%, 11/06/28	528 282	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
2 000 000 USD	BP Capital Markets America Inc, 4.893%, 11/09/33	2 038 260	0,03	1 000 000 USD	Broadcom Inc, 4.926%, 15/05/37	969 110	0,02
325 000 USD	BP Capital Markets America Inc, 2.772%, 10/11/50	218 725	0,00	1 065 000 USD	Broadcom Inc, 3.500%, 15/02/41	846 920	0,01
350 000 USD	BP Capital Markets America Inc, 3.001%, 17/03/52	246 837	0,00	40 000 USD	Broadcom Inc, 3.750%, 15/02/51	31 579	0,00
350 000 USD	BP Capital Markets America Inc, 3.379%, 08/02/61	254 467	0,00	1 000 000 USD	BROADCOM INC, 4.150%, perpetual	945 280	0,01
150 000 USD	Brighthouse Financial Inc, 3.700%, 22/06/27	141 888	0,00	250 000 USD	Broadridge Financial Solutions Inc, 2.900%, 01/12/29	224 180	0,00
100 000 USD	Brighthouse Financial Inc, 4.700%, 22/06/47	79 515	0,00	100 000 USD	Brookfield Finance LLC / Brookfield Finance Inc, 3.450%, 15/04/50	69 801	0,00
50 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 0.750%, 13/11/25	46 668	0,00	100 000 USD	Brooklyn Union Gas Co, 3.407%, 10/03/26	95 546	0,00
50 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 3.200%, 15/06/26	48 539	0,00	200 000 USD	Brown & Brown Inc, 4.500%, 15/03/29	195 046	0,00
50 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 1.125%, 13/11/27	44 458	0,00	500 000 USD	Brown & Brown Inc, 4.200%, 17/03/32	458 110	0,01
41 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 3.400%, 26/07/29	38 919	0,00	125 000 USD	Bunge Ltd Finance Corp, 1.630%, 17/08/25	118 138	0,00
30 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 1.450%, 13/11/30	24 681	0,00	30 000 USD	Bunge Ltd Finance Corp, 3.750%, 25/09/27	28 940	0,00
500 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 2.950%, 15/03/32	445 030	0,01	500 000 USD	Bunge Ltd Finance Corp, 2.750%, 14/05/31	435 635	0,01
300 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 4.125%, 15/06/39	271 371	0,00	50 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 3.650%, 01/09/25	49 129	0,00
20 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 2.350%, 13/11/40	13 988	0,00	200 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 6.200%, 15/08/36	225 066	0,00
500 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 3.550%, 15/03/42	410 295	0,01	25 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 6.150%, 01/05/37	28 123	0,00
100 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 4.550%, 20/02/48	91 357	0,00	100 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 5.750%, 01/05/40	109 242	0,00
85 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 4.250%, 26/10/49	73 980	0,00	100 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 4.400%, 15/03/42	92 717	0,00
1 030 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 2.550%, 13/11/50	654 101	0,01	55 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 4.550%, 01/09/44	51 442	0,00
25 000 USD	Brixmor Operating Partnership LP, 4.125%, 15/06/26	24 200	0,00	50 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 4.700%, 01/09/45	48 190	0,00
100 000 USD	Brixmor Operating Partnership LP, 4.125%, 15/05/29	95 307	0,00	100 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 4.125%, 15/06/47	88 004	0,00
100 000 USD	Brixmor Operating Partnership LP, 4.050%, 01/07/30	93 960	0,00	155 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 4.150%, 15/12/48	136 952	0,00
200 000 USD	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd, 3.875%, 15/01/27	195 258	0,00	100 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 3.550%, 15/02/50	80 682	0,00
100 000 USD	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd, 3.500%, 15/01/28	95 959	0,00	30 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 3.050%, 15/02/51	21 786	0,00
364 000 USD	Broadcom Inc, 3.459%, 15/09/26	351 839	0,01	550 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 3.300%, 15/09/51	419 457	0,01
380 000 USD	Broadcom Inc, 1.950%, 15/02/28	341 221	0,01	500 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 2.875%, 15/06/52	350 980	0,01
212 000 USD	Broadcom Inc, 4.110%, 15/09/28	207 364	0,00	1 500 000 USD	Burlington Northern Santa Fe LLC, 5.200%, 15/04/54	1 567 890	0,02
200 000 USD	Broadcom Inc, 4.750%, 15/04/29	200 586	0,00	600 000 USD	Cabot Corp, 5.000%, 30/06/32	593 208	0,01
200 000 USD	Broadcom Inc, 4.150%, 15/11/30	191 294	0,00	45 000 USD	California Institute of Technology, 3.650%, 01/09/19	32 084	0,00
200 000 USD	Broadcom Inc, 2.450%, 15/02/31	171 348	0,00	165 000 USD	Camden Property Trust, 3.150%, 01/07/29	152 759	0,00
500 000 USD	Broadcom Inc, 2.600%, 15/02/33	412 255	0,01	300 000 USD	Cameron LNG LLC, 3.402%, 15/01/38	253 524	0,00
500 000 USD	Broadcom Inc, 3.419%, 15/04/33	439 895	0,01				
500 000 USD	Broadcom Inc, 3.137%, 15/11/35	411 115	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
300 000 USD	Cameron LNG LLC, 3.701%, 15/01/39	255 081	0,00	500 000 USD	Caterpillar Financial Services Corp, 1.150%, 14/09/26	459 150	0,01
350 000 USD	Campbell Soup Co, 4.150%, 15/03/28	343 255	0,01	100 000 USD	Caterpillar Inc, 2.600%, 19/09/29	92 140	0,00
20 000 USD	Campbell Soup Co, 4.800%, 15/03/48	18 306	0,00	600 000 USD	Caterpillar Inc, 1.900%, 12/03/31	516 738	0,01
1 000 000 USD	Cantor Fitzgerald LP, 4.500%, 14/04/27	959 530	0,02	175 000 USD	Caterpillar Inc, 3.803%, 15/08/42	154 175	0,00
150 000 USD	Capital One Financial Corp, 3.200%, 05/02/25	146 445	0,00	200 000 USD	Caterpillar Inc, 3.250%, 19/09/49	158 892	0,00
300 000 USD	Capital One Financial Corp, 2.636%, 03/03/26	287 481	0,01	100 000 USD	Cboe Global Markets Inc, 1.625%, 15/12/30	82 391	0,00
200 000 USD	Capital One Financial Corp, 3.750%, 28/07/26	191 596	0,00	500 000 USD	CDW LLC / CDW Finance Corp, 2.670%, 01/12/26	467 915	0,01
200 000 USD	Capital One Financial Corp, 3.750%, 09/03/27	191 294	0,00	100 000 EUR	Celanese US Holdings LLC, 1.250%, 11/02/25	107 267	0,00
500 000 USD	Capital One Financial Corp, 1.878%, 02/11/27	449 755	0,01	200 000 EUR	Celanese US Holdings LLC, 5.337%, 19/01/29	231 610	0,00
300 000 USD	Capital One Financial Corp, 3.800%, 31/01/28	285 234	0,00	50 000 USD	Cencora Inc, 3.450%, 15/12/27	48 132	0,00
1 000 000 USD	Capital One Financial Corp, 5.468%, 01/02/29	998 830	0,02	50 000 USD	Cencora Inc, 4.300%, 15/12/47	44 919	0,00
100 000 EUR	Capital One Financial Corp, 1.650%, 12/06/29	97 234	0,00	140 000 USD	CenterPoint Energy Houston Electric LLC, 2.350%, 01/04/31	119 944	0,00
500 000 USD	Capital One Financial Corp, 3.273%, 01/03/30	446 515	0,01	1 000 000 USD	CenterPoint Energy Houston Electric LLC, 4.950%, 01/04/33	1 020 790	0,02
500 000 USD	Cardinal Health Inc, 3.410%, 15/06/27	480 335	0,01	1 000 000 USD	CenterPoint Energy Houston Electric LLC, 5.300%, 01/04/53	1 050 710	0,02
100 000 USD	Cardinal Health Inc, 4.600%, 15/03/43	89 128	0,00	100 000 USD	CenterPoint Energy Resources Corp, 4.000%, 01/04/28	97 475	0,00
300 000 USD	Cargill Inc, 0.750%, 02/02/26	277 353	0,00	1 300 000 USD	CenterPoint Energy Resources Corp, 4.400%, 01/07/32	1 264 549	0,02
600 000 USD	Cargill Inc, 1.700%, 02/02/31	492 918	0,01	100 000 USD	CF Industries Inc, 4.500%, 01/12/26	97 967	0,00
500 000 USD	Cargill Inc, 2.125%, 10/11/31	417 480	0,01	100 000 USD	Charles Schwab Corp, 3.000%, 10/03/25	97 413	0,00
35 000 USD	Carlisle Cos Inc, 2.750%, 01/03/30	31 092	0,00	300 000 USD	Charles Schwab Corp, 3.850%, 21/05/25	294 636	0,01
300 000 USD	Carlyle Holdings II Finance LLC, 5.625%, 30/03/43	292 005	0,01	600 000 USD	Charles Schwab Corp, 1.150%, 13/05/26	549 834	0,01
350 000 USD	Carrier Global Corp, 2.242%, 15/02/25	338 688	0,01	100 000 USD	Charles Schwab Corp, 3.200%, 02/03/27	95 455	0,00
50 000 USD	Carrier Global Corp, 2.493%, 15/02/27	47 087	0,00	500 000 USD	Charles Schwab Corp, 2.450%, 03/03/27	465 780	0,01
500 000 EUR	Carrier Global Corp, 4.125%, 29/05/28	569 182	0,01	500 000 USD	Charles Schwab Corp, 6.196%, 17/11/29	525 315	0,01
70 000 USD	Carrier Global Corp, 2.722%, 15/02/30	62 738	0,00	500 000 USD	Charles Schwab Corp, 2.300%, 13/05/31	418 520	0,01
50 000 USD	Carrier Global Corp, 3.377%, 05/04/40	40 240	0,00	300 000 USD	Charles Schwab Corp, 2.900%, 03/03/32	258 822	0,00
370 000 USD	Carrier Global Corp, 3.577%, 05/04/50	289 658	0,01	1 000 000 USD	Charles Schwab Corp, 6.136%, 24/08/34	1 053 300	0,02
1 000 000 USD	Caterpillar Financial Services Corp, 4.900%, 17/01/25	1 000 430	0,02	225 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4.908%, 23/07/25	222 912	0,00
1 000 000 USD	Caterpillar Financial Services Corp, 5.150%, 11/08/25	1 007 500	0,02	100 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.750%, 15/02/28	94 519	0,00
90 000 USD	Caterpillar Financial Services Corp, 0.800%, 13/11/25	84 054	0,00	500 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2.250%, 15/01/29	434 230	0,01
600 000 USD	Caterpillar Financial Services Corp, 0.900%, 02/03/26	556 242	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
200 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2.300%, 01/02/32	159 354	0,00	105 000 USD	Chenierye Corpus Christi Holdings LLC, 3.700%, 15/11/29	99 251	0,00
150 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6.384%, 23/10/35	152 733	0,00	150 000 USD	Chevron Corp, 2.954%, 16/05/26	145 119	0,00
1 000 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.500%, 01/06/41	709 630	0,01	335 000 USD	Chevron USA Inc, 0.687%, 12/08/25	315 011	0,01
500 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.500%, 01/03/42	349 380	0,01	600 000 USD	Chevron USA Inc, 3.850%, 15/01/28	592 626	0,01
195 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6.484%, 23/10/45	192 547	0,00	1 350 000 USD	Chevron USA Inc, 3.250%, 15/10/29	1 284 862	0,02
25 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5.375%, 01/05/47	21 360	0,00	315 000 USD	Chevron USA Inc, 2.343%, 12/08/50	202 794	0,00
300 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5.750%, 01/04/48	267 339	0,00	415 000 USD	Children's Health System of Texas, 2.511%, 15/08/50	260 234	0,00
100 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5.125%, 01/07/49	81 547	0,00	50 000 USD	Choice Hotels International Inc, 3.700%, 01/12/29	44 329	0,00
225 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4.800%, 01/03/50	175 664	0,00	200 000 USD	Chubb INA Holdings Inc, 3.150%, 15/03/25	195 664	0,00
160 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.700%, 01/04/51	104 381	0,00	100 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 0.875%, 15/06/27	103 447	0,00
600 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.900%, 01/06/52	406 128	0,01	100 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 0.875%, 15/12/29	97 829	0,00
35 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6.834%, 23/10/55	35 332	0,00	415 000 USD	Chubb INA Holdings Inc, 1.375%, 15/09/30	342 483	0,01
200 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.850%, 01/04/61	125 786	0,00	600 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 1.400%, 15/06/31	583 733	0,01
100 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4.400%, 01/12/61	69 481	0,00	500 000 USD	Chubb INA Holdings Inc, 3.050%, 15/12/61	359 930	0,01
500 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.950%, 30/06/62	318 290	0,01	250 000 USD	Cigna Group, 3.250%, 15/04/25	243 990	0,00
				300 000 USD	Cigna Group, 4.125%, 15/11/25	296 163	0,01
				80 000 USD	Cigna Group, 4.375%, 15/10/28	79 290	0,00
				360 000 USD	Cigna Group, 4.800%, 15/08/38	348 782	0,01
				50 000 USD	Cigna Group, 6.125%, 15/11/41	54 924	0,00
				200 000 USD	Cigna Group, 4.800%, 15/07/46	188 486	0,00
				150 000 USD	Cigna Group, 3.875%, 15/10/47	122 382	0,00
				305 000 USD	Cigna Group, 4.900%, 15/12/48	290 168	0,01
				50 000 USD	Cintas Corp No 2, 3.700%, 01/04/27	48 895	0,00
				45 000 USD	Cisco Systems Inc, 3.500%, 15/06/25	44 384	0,00
				100 000 USD	Cisco Systems Inc, 2.500%, 20/09/26	95 423	0,00
				200 000 USD	Cisco Systems Inc, 5.900%, 15/02/39	222 338	0,00
				1 000 000 USD	Citibank NA, 5.803%, 29/09/28	1 043 460	0,02
				200 000 USD	Citigroup Inc, 3.875%, 26/03/25	196 334	0,00
				145 000 USD	Citigroup Inc, 2.014%, 25/01/26	139 335	0,00
				300 000 USD	Citigroup Inc, 3.290%, 17/03/26	292 140	0,01
				1 500 000 USD	Citigroup Inc, 3.106%, 08/04/26	1 458 585	0,02
				800 000 EUR	Citigroup Inc, 1.250%, 06/07/26	850 925	0,01
				100 000 USD	Citigroup Inc, 3.200%, 21/10/26	95 403	0,00
				100 000 GBP	Citigroup Inc, 1.750%, 23/10/26	117 979	0,00
				500 000 USD	Citigroup Inc, 1.122%, 28/01/27	459 750	0,01
				100 000 USD	Citigroup Inc, 4.450%, 29/09/27	97 747	0,00
				200 000 USD	Citigroup Inc, 3.887%, 10/01/28	193 570	0,00
				200 000 USD	Citigroup Inc, 3.668%, 24/07/28	190 724	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 EUR	Citigroup Inc, 3.713%, 22/09/28	112 081	0,00	200 000 EUR	Colgate-Palmolive Co, 0.500%, 06/03/26	210 151	0,00
100 000 EUR	Citigroup Inc, 1.500%, 26/10/28	101 727	0,00	100 000 EUR	Colgate-Palmolive Co, 0.300%, 10/11/29	96 571	0,00
300 000 USD	Citigroup Inc, 3.520%, 27/10/28	283 911	0,00	150 000 USD	Columbia Pipeline Group Inc, 5.800%, 01/06/45	150 183	0,00
100 000 EUR	Citigroup Inc, 1.250%, 10/04/29	99 315	0,00	1 500 000 USD	Columbia Pipelines Operating Co LLC, 6.497%, 15/08/43	1 612 755	0,02
150 000 USD	Citigroup Inc, 4.075%, 23/04/29	144 624	0,00	150 000 USD	Comcast Corp, 3.950%, 15/10/25	148 078	0,00
150 000 USD	Citigroup Inc, 3.980%, 20/03/30	142 333	0,00	100 000 EUR	Comcast Corp, 0.010%, 14/09/26	101 887	0,00
400 000 USD	Citigroup Inc, 2.976%, 05/11/30	356 392	0,01	100 000 EUR	Comcast Corp, 0.250%, 20/05/27	101 271	0,00
300 000 USD	Citigroup Inc, 2.572%, 03/06/31	256 641	0,00	500 000 USD	Comcast Corp, 5.350%, 15/11/27	517 235	0,01
1 085 000 USD	Citigroup Inc, 2.561%, 01/05/32	906 680	0,01	100 000 USD	Comcast Corp, 3.150%, 15/02/28	95 441	0,00
135 000 USD	Citigroup Inc, 3.057%, 25/01/33	115 332	0,00	95 000 USD	Comcast Corp, 4.150%, 15/10/28	93 779	0,00
100 000 EUR	Citigroup Inc, 4.112%, 22/09/33	113 952	0,00	300 000 GBP	Comcast Corp, 1.500%, 20/02/29	337 427	0,01
200 000 USD	Citigroup Inc, 6.000%, 31/10/33	211 344	0,00	100 000 EUR	Comcast Corp, 0.250%, 14/09/29	95 504	0,00
500 000 USD	Citigroup Inc, 6.270%, 17/11/33	535 750	0,01	500 000 USD	Comcast Corp, 3.400%, 01/04/30	468 255	0,01
100 000 GBP	Citigroup Inc, 6.800%, 25/06/38	152 373	0,00	70 000 USD	Comcast Corp, 4.250%, 15/10/30	69 065	0,00
300 000 USD	Citigroup Inc, 3.878%, 24/01/39	259 476	0,00	175 000 USD	Comcast Corp, 1.950%, 15/01/31	147 745	0,00
200 000 USD	Citigroup Inc, 8.125%, 15/07/39	258 630	0,00	500 000 USD	Comcast Corp, 1.500%, 15/02/31	410 170	0,01
500 000 USD	Citigroup Inc, 5.316%, 26/03/41	501 870	0,01	100 000 EUR	Comcast Corp, 0.750%, 20/02/32	92 886	0,00
500 000 USD	Citigroup Inc, 2.904%, 03/11/42	360 635	0,01	500 000 USD	Comcast Corp, 5.500%, 15/11/32	532 395	0,01
150 000 USD	Citigroup Inc, 6.675%, 13/09/43	168 879	0,00	1 000 000 USD	Comcast Corp, 4.650%, 15/02/33	1 009 960	0,02
50 000 USD	Citigroup Inc, 4.281%, 24/04/48	43 837	0,00	35 000 USD	Comcast Corp, 5.650%, 15/06/35	37 687	0,00
1 000 000 USD	Citigroup Inc, 1.462%, perpetual	915 250	0,01	300 000 USD	Comcast Corp, 6.500%, 15/11/35	343 878	0,01
200 000 USD	Citizens Financial Group Inc, 2.850%, 27/07/26	186 324	0,00	200 000 GBP	Comcast Corp, 1.875%, 20/02/36	192 332	0,00
50 000 USD	CNA Financial Corp, 4.500%, 01/03/26	49 466	0,00	200 000 USD	Comcast Corp, 3.200%, 15/07/36	168 568	0,00
300 000 USD	CNA Financial Corp, 3.450%, 15/08/27	287 130	0,01	200 000 USD	Comcast Corp, 3.900%, 01/03/38	179 340	0,00
200 000 USD	CNA Financial Corp, 3.900%, 01/05/29	191 740	0,00	285 000 USD	Comcast Corp, 4.600%, 15/10/38	276 647	0,00
500 000 USD	CNH Industrial Capital LLC, 4.550%, 10/04/28	493 840	0,01	100 000 EUR	Comcast Corp, 1.250%, 20/02/40	83 565	0,00
500 000 USD	CNO Global Funding, 1.750%, 07/10/26	453 900	0,01	755 000 USD	Comcast Corp, 3.750%, 01/04/40	651 044	0,01
500 000 USD	CNOOC Finance 2015 USA LLC, 4.375%, 02/05/28	498 335	0,01	100 000 USD	Comcast Corp, 4.000%, 15/08/47	84 516	0,00
100 000 USD	Coca-Cola Co, 2.900%, 25/05/27	95 816	0,00	30 000 USD	Comcast Corp, 3.969%, 01/11/47	25 270	0,00
615 000 USD	Coca-Cola Co, 1.500%, 05/03/28	554 779	0,01	75 000 USD	Comcast Corp, 4.700%, 15/10/48	71 768	0,00
100 000 CHF	Coca-Cola Co, 1.000%, 02/10/28	117 770	0,00	52 000 USD	Comcast Corp, 3.999%, 01/11/49	43 560	0,00
300 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.125%, 09/03/29	288 685	0,01	300 000 USD	Comcast Corp, 3.450%, 01/02/50	231 144	0,00
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.400%, 06/05/30	94 820	0,00	110 000 USD	Comcast Corp, 2.800%, 15/01/51	73 379	0,00
635 000 USD	Coca-Cola Co, 2.000%, 05/03/31	549 262	0,01	544 000 USD	Comcast Corp, 2.887%, 01/11/51	369 186	0,01
500 000 USD	Coca-Cola Co, 2.250%, 05/01/32	436 695	0,01	500 000 USD	Comcast Corp, 5.350%, 15/05/53	518 900	0,01
500 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.500%, 09/03/33	444 252	0,01	398 000 USD	Comcast Corp, 2.937%, 01/11/56	262 811	0,00
200 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.375%, 15/03/33	175 812	0,00	305 000 USD	Comcast Corp, 4.950%, 15/10/58	300 779	0,01
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.625%, 09/03/35	95 457	0,00	35 000 USD	CommonSpirit Health, 1.547%, 01/10/25	32 750	0,00
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.950%, 06/05/36	86 001	0,00	25 000 USD	CommonSpirit Health, 3.347%, 01/10/29	22 817	0,00
110 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.800%, 15/03/40	84 634	0,00	50 000 USD	CommonSpirit Health, 2.782%, 01/10/30	43 308	0,00
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.000%, 09/03/41	79 022	0,00	45 000 USD	CommonSpirit Health, 4.187%, 01/10/49	38 036	0,00
500 000 USD	Coca-Cola Co, 2.875%, 05/05/41	397 330	0,01	75 000 USD	CommonSpirit Health, 3.910%, 01/10/50	59 330	0,00
385 000 USD	Coca-Cola Co, 3.000%, 05/03/51	291 822	0,01	100 000 USD	Commonwealth Edison Co, 2.950%, 15/08/27	94 539	0,00
200 000 USD	Coca-Cola Consolidated Inc, 3.800%, 25/11/25	195 658	0,00				
100 000 EUR	Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1.875%, 18/03/30	102 413	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
45 000 USD	Commonwealth Edison Co, 3.700%, 15/08/28	43 561	0,00	125 000 USD	Constellation Brands Inc, 2.250%, 01/08/31	105 230	0,00
100 000 USD	Commonwealth Edison Co, 5.900%, 15/03/36	108 386	0,00	200 000 USD	Constellation Brands Inc, 4.100%, 15/02/48	170 250	0,00
50 000 USD	Commonwealth Edison Co, 4.350%, 15/11/45	43 967	0,00	120 000 USD	Constellation Energy Generation LLC, 3.250%, 01/06/25	116 590	0,00
50 000 USD	Commonwealth Edison Co, 3.650%, 15/06/46	39 654	0,00	1 000 000 USD	Constellation Energy Generation LLC, 5.600%, 01/03/28	1 030 910	0,02
100 000 USD	Commonwealth Edison Co, 3.750%, 15/08/47	80 961	0,00	400 000 USD	Constellation Energy Generation LLC, 6.250%, 01/10/39	429 596	0,01
100 000 USD	Conagra Brands Inc, 1.375%, 01/11/27	87 939	0,00	50 000 USD	Constellation Energy Generation LLC, 5.600%, 15/06/42	50 182	0,00
45 000 USD	Conagra Brands Inc, 4.850%, 01/11/28	45 033	0,00	2 000 000 USD	Continental Resources Inc, 2.268%, 15/11/26	1 842 500	0,03
25 000 USD	Conagra Brands Inc, 5.300%, 01/11/38	24 545	0,00	1 000 000 USD	Cooperatieve Rabobank UA, 5.500%, 18/07/25	1 009 990	0,02
40 000 USD	Conagra Brands Inc, 5.400%, 01/11/48	38 825	0,00	1 000 000 USD	Corebridge Financial Inc, 3.500%, 04/04/25	975 840	0,02
1 000 000 USD	Concentrix Corp, 6.650%, 02/08/26	1 024 940	0,02	500 000 USD	Corebridge Financial Inc, 3.850%, 05/04/29	472 435	0,01
25 000 USD	Connecticut Light and Power Co, 4.000%, 01/04/48	21 378	0,00	500 000 USD	Corebridge Financial Inc, 3.900%, 05/04/32	453 070	0,01
1 000 000 USD	Connecticut Light and Power Co, 5.250%, 15/01/53	1 024 290	0,02	1 000 000 USD	Corebridge Financial Inc, 4.350%, 05/04/42	848 480	0,01
15 000 USD	ConocoPhillips, 5.900%, 15/10/32	16 497	0,00	100 000 USD	Corning Inc, 4.750%, 15/03/42	93 604	0,00
200 000 USD	ConocoPhillips, 6.500%, 01/02/39	232 380	0,00	35 000 USD	Corporate Office Properties LP, 2.250%, 15/03/26	32 692	0,00
50 000 USD	ConocoPhillips Co, 6.950%, 15/04/29	55 772	0,00	100 000 USD	Costco Wholesale Corp, 3.000%, 18/05/27	96 368	0,00
1 500 000 USD	ConocoPhillips Co, 3.758%, 15/03/42	1 271 970	0,02	500 000 USD	Costco Wholesale Corp, 1.600%, 20/04/30	428 830	0,01
1 000 000 USD	ConocoPhillips Co, 5.550%, 15/03/54	1 066 440	0,02	1 405 000 USD	Coterra Energy Inc, 3.900%, 15/05/27	1 359 450	0,02
1 000 000 USD	Consolidated Edison Co of New York Inc, 5.200%, 01/03/33	1 036 440	0,02	100 000 USD	Cox Communications Inc, 3.350%, 15/09/26	95 891	0,00
15 000 USD	Consolidated Edison Co of New York Inc, 6.750%, 01/04/38	17 184	0,00	100 000 USD	Cox Communications Inc, 3.500%, 15/08/27	95 170	0,00
200 000 USD	Consolidated Edison Co of New York Inc, 5.700%, 15/06/40	208 052	0,00	1 000 000 USD	Cox Communications Inc, 5.450%, 15/09/28	1 022 990	0,02
100 000 USD	Consolidated Edison Co of New York Inc, 4.450%, 15/03/44	89 991	0,00	34 000 USD	Cox Communications Inc, 4.700%, 15/12/42	29 548	0,00
100 000 USD	Consolidated Edison Co of New York Inc, 3.875%, 15/06/47	81 461	0,00	500 000 USD	Crown Castle Inc, 1.350%, 15/07/25	472 130	0,01
200 000 USD	Consolidated Edison Co of New York Inc, 4.125%, 15/05/49	168 258	0,00	85 000 USD	Crown Castle Inc, 3.700%, 15/06/26	82 116	0,00
1 000 000 USD	Consolidated Edison Co of New York Inc, 6.150%, 15/11/52	1 141 500	0,02	135 000 USD	Crown Castle Inc, 4.000%, 01/03/27	130 746	0,00
100 000 USD	Consolidated Edison Co of New York Inc, 4.300%, 01/12/56	84 338	0,00	1 000 000 USD	Crown Castle Inc, 5.000%, 11/01/28	997 740	0,02
105 000 USD	Consolidated Edison Co of New York Inc, 3.000%, 01/12/60	68 726	0,00	60 000 USD	Crown Castle Inc, 3.300%, 01/07/30	53 903	0,00
1 000 000 USD	Constellation Brands Inc, 5.000%, 02/02/26	999 890	0,02	500 000 USD	Crown Castle Inc, 2.250%, 15/01/31	414 630	0,01
100 000 USD	Constellation Brands Inc, 3.500%, 09/05/27	96 333	0,00	500 000 USD	Crown Castle Inc, 2.900%, 01/04/41	357 725	0,01
200 000 USD	Constellation Brands Inc, 3.150%, 01/08/29	186 082	0,00	125 000 USD	Crown Castle Inc, 4.750%, 15/05/47	108 824	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
500 000 USD	Crown Castle Inc, 2.900%, perpetual	468 080	0,01	300 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 5.850%, 15/07/25	302 973	0,01
200 000 USD	CSX Corp, 2.600%, 01/11/26	190 486	0,00	385 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 6.020%, 15/06/26	394 051	0,01
65 000 USD	CSX Corp, 4.250%, 15/03/29	64 984	0,00	600 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 4.900%, 01/10/26	600 714	0,01
50 000 USD	CSX Corp, 2.400%, 15/02/30	44 303	0,00	25 000 USD	CSX Corp, 6.150%, 01/05/37	27 972	0,00
25 000 USD	CSX Corp, 6.150%, 01/05/37	27 972	0,00	100 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 5.300%, 01/10/29	103 120	0,00
1 116 000 USD	CSX Corp, 4.100%, 15/03/44	980 294	0,02	1 000 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 5.750%, 01/02/33	1 054 980	0,02
150 000 USD	CSX Corp, 4.500%, 01/08/54	139 017	0,00	73 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 8.100%, 15/07/36	89 876	0,00
200 000 USD	CSX Corp, 4.650%, 01/03/68	184 444	0,00	1 000 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 3.375%, 15/12/41	758 720	0,01
125 000 USD	CubeSmart LP, 2.000%, 15/02/31	102 089	0,00	29 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 8.350%, 15/07/46	38 345	0,00
500 000 USD	Cummins Inc, 1.500%, 01/09/30	418 295	0,01	500 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 3.450%, 15/12/51	363 500	0,01
25 000 USD	CVS Health Corp, 4.100%, 25/03/25	24 762	0,00	500 000 USD	Deutsche Bank AG, 2.311%, 16/11/27	457 310	0,01
160 000 USD	CVS Health Corp, 3.875%, 20/07/25	157 258	0,00	500 000 USD	Deutsche Bank AG, 6.819%, 20/11/29	526 515	0,01
35 000 USD	CVS Health Corp, 3.000%, 15/08/26	33 486	0,00	45 000 USD	Diamondback Energy Inc, 3.250%, 01/12/26	43 669	0,00
265 000 USD	CVS Health Corp, 1.300%, 21/08/27	235 611	0,00	100 000 USD	Diamondback Energy Inc, 3.500%, 01/12/29	92 982	0,00
220 000 USD	CVS Health Corp, 4.300%, 25/03/28	216 502	0,00	1 000 000 USD	Diamondback Energy Inc, 6.250%, 15/03/33	1 069 900	0,02
500 000 USD	CVS Health Corp, 5.000%, 30/01/29	508 985	0,01	680 000 USD	Diamondback Energy Inc, 4.250%, 15/03/52	550 501	0,01
50 000 USD	CVS Health Corp, 3.250%, 15/08/29	46 610	0,00	500 000 USD	Dick's Sporting Goods Inc, 4.100%, 15/01/52	358 710	0,01
250 000 USD	CVS Health Corp, 1.750%, 21/08/30	206 950	0,00	100 000 EUR	Digital Euro Finco LLC, 1.125%, 09/04/28	99 971	0,00
500 000 USD	CVS Health Corp, 5.300%, 01/06/33	513 165	0,01	200 000 USD	Digital Realty Trust LP, 3.700%, 15/08/27	193 272	0,00
265 000 USD	CVS Health Corp, 4.780%, 25/03/38	251 268	0,00	1 000 000 USD	Digital Realty Trust LP, 5.550%, 15/01/28	1 019 240	0,02
200 000 USD	CVS Health Corp, 4.125%, 01/04/40	172 106	0,00	200 000 USD	Digital Realty Trust LP, 3.600%, 01/07/29	188 118	0,00
1 085 000 USD	CVS Health Corp, 2.700%, 21/08/40	776 220	0,01	200 000 GBP	Digital Stout Holding LLC, 3.750%, 17/10/30	237 804	0,00
150 000 USD	CVS Health Corp, 5.300%, 05/12/43	145 495	0,00	120 000 USD	Dignity Health, 4.500%, 01/11/42	106 273	0,00
185 000 USD	CVS Health Corp, 5.125%, 20/07/45	175 674	0,00	250 000 USD	Discover Bank, 3.450%, 27/07/26	236 580	0,00
170 000 USD	CVS Health Corp, 5.050%, 25/03/48	159 691	0,00	500 000 USD	DisCover Financial Services, 6.700%, 29/11/32	524 315	0,01
200 000 USD	CVS Health Corp, 4.250%, 01/04/50	167 044	0,00	110 000 USD	Discovery Communications LLC, 3.950%, 20/03/28	104 845	0,00
500 000 USD	CVS Health Corp, 5.625%, 21/02/53	508 460	0,01	70 000 USD	Discovery Communications LLC, 4.125%, 15/05/29	66 445	0,00
500 000 USD	CVS Health Corp, 5.875%, 01/06/53	527 885	0,01	125 000 USD	Discovery Communications LLC, 3.625%, 15/05/30	113 555	0,00
500 000 USD	Daimler Truck Finance North America LLC, 2.000%, 14/12/26	460 225	0,01	30 000 USD	Discovery Communications LLC, 5.200%, 20/09/47	25 927	0,00
500 000 USD	Daimler Truck Finance North America LLC, 2.500%, 14/12/31	415 020	0,01	452 000 USD	Discovery Communications LLC, 4.000%, 15/09/55	322 249	0,01
1 000 000 USD	Daimler Truck Finance North America LLC, 3.500%, perpetual	978 980	0,02				
400 000 EUR	Danaher Corp, 2.500%, 30/03/30	428 701	0,01				
15 000 USD	Darden Restaurants Inc, 4.550%, 15/02/48	12 752	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
50 000 USD	Dollar General Corp, 4.150%, 01/11/25	49 200	0,00	100 000 EUR	DXC Technology Co, 1.750%, 15/01/26	106 639	0,00
1 000 000 USD	Dollar General Corp, 5.200%, 05/07/28	1 014 930	0,02	100 000 USD	Eaton Corp, 4.150%, 02/11/42	91 952	0,00
1 000 000 USD	Dollar General Corp, 5.000%, 01/11/32	999 410	0,02	120 000 USD	eBay Inc, 1.900%, 11/03/25	115 408	0,00
100 000 USD	Dollar Tree Inc, 4.000%, 15/05/25	98 232	0,00	500 000 USD	eBay Inc, 5.900%, 22/11/25	508 455	0,01
345 000 USD	Dollar Tree Inc, 4.200%, 15/05/28	338 062	0,01	100 000 USD	eBay Inc, 2.700%, 11/03/30	89 158	0,00
500 000 USD	Dollar Tree Inc, 2.650%, 01/12/31	425 360	0,01	650 000 USD	eBay Inc, 2.600%, 10/05/31	567 521	0,01
1 075 000 USD	Dominion Energy Inc, 1.450%, 15/04/26	996 708	0,02	500 000 USD	eBay Inc, 6.300%, 22/11/32	551 370	0,01
100 000 USD	Dominion Energy Inc, 2.850%, 15/08/26	94 296	0,00	70 000 USD	Ecolab Inc, 3.250%, 01/12/27	67 262	0,00
150 000 USD	Dominion Energy Inc, 4.250%, 01/06/28	147 363	0,00	800 000 USD	Ecolab Inc, 2.750%, 18/08/55	539 848	0,01
90 000 USD	Dominion Energy Inc, 3.375%, 01/04/30	83 018	0,00	40 000 USD	Edison International, 4.950%, 15/04/25	39 728	0,00
500 000 USD	Dominion Energy Inc, 2.250%, 15/08/31	414 265	0,01	1 500 000 USD	Edison International, 4.700%, 15/08/25	1 482 315	0,02
1 000 000 USD	Dominion Energy Inc, 5.375%, 15/11/32	1 027 270	0,02	25 000 USD	Edison International, 5.750%, 15/06/27	25 570	0,00
10 000 USD	Dominion Energy Inc, 5.250%, 01/08/33	10 171	0,00	50 000 USD	Electronic Arts Inc, 4.800%, 01/03/26	50 117	0,00
565 000 USD	Dominion Energy Inc, 3.300%, 15/04/41	432 394	0,01	105 000 USD	Elevance Health Inc, 2.375%, 15/01/25	102 037	0,00
50 000 USD	Dominion Energy Inc, 4.900%, 01/08/41	46 345	0,00	1 000 000 USD	Elevance Health Inc, 5.350%, 15/10/25	1 006 350	0,02
2 000 000 USD	Dominion Energy Inc, 4.850%, 15/08/52	1 850 320	0,03	100 000 USD	Elevance Health Inc, 1.500%, 15/03/26	93 190	0,00
1 000 000 USD	Dominion Energy South Carolina Inc, 6.250%, 15/10/53	1 155 610	0,02	65 000 USD	Elevance Health Inc, 3.650%, 01/12/27	63 022	0,00
100 000 USD	Dominion Energy South Carolina Inc, 5.100%, 01/06/65	95 775	0,00	50 000 USD	Elevance Health Inc, 4.101%, 01/03/28	49 233	0,00
100 000 EUR	Dover Corp, 1.250%, 09/11/26	105 230	0,00	85 000 USD	Elevance Health Inc, 2.250%, 15/05/30	73 726	0,00
100 000 EUR	Dow Chemical Co, 0.500%, 15/03/27	101 347	0,00	100 000 USD	Elevance Health Inc, 2.550%, 15/03/31	86 767	0,00
117 000 USD	Dow Chemical Co, 7.375%, 01/11/29	132 115	0,00	100 000 USD	Elevance Health Inc, 4.650%, 15/08/44	92 898	0,00
250 000 USD	Dow Chemical Co, 2.100%, 15/11/30	214 380	0,00	65 000 USD	Elevance Health Inc, 4.375%, 01/12/47	58 132	0,00
100 000 EUR	Dow Chemical Co, 1.875%, 15/03/40	83 476	0,00	50 000 USD	Elevance Health Inc, 4.550%, 01/03/48	45 660	0,00
100 000 USD	Dow Chemical Co, 4.375%, 15/11/42	88 648	0,00	105 000 USD	Elevance Health Inc, 3.125%, 15/05/50	76 069	0,00
145 000 USD	Dow Chemical Co, 4.800%, 15/05/49	133 510	0,00	30 000 USD	Elevance Health Inc, 3.600%, 15/03/51	23 602	0,00
250 000 USD	Dow Chemical Co, 3.600%, 15/11/50	193 725	0,00	500 000 USD	Elevance Health Inc, 4.550%, 15/05/52	457 985	0,01
100 000 USD	DR Horton Inc, 1.400%, 15/10/27	89 187	0,00	48 000 USD	Eli Lilly & Co, 2.750%, 01/06/25	46 729	0,00
100 000 USD	Duke University Health System Inc, 3.920%, 01/06/47	85 299	0,00	100 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.625%, 02/06/26	107 328	0,00
150 000 USD	DuPont de Nemours Inc, 4.725%, 15/11/28	152 583	0,00	27 000 USD	Eli Lilly & Co, 3.375%, 15/03/29	25 996	0,00
65 000 USD	DuPont de Nemours Inc, 5.319%, 15/11/38	66 890	0,00	100 000 EUR	Eli Lilly & Co, 0.500%, 14/09/33	89 956	0,00
75 000 USD	DuPont de Nemours Inc, 5.419%, 15/11/48	78 482	0,00	100 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.700%, 01/11/49	83 412	0,00
				250 000 USD	Eli Lilly & Co, 2.250%, 15/05/50	162 262	0,00
				100 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.125%, 14/09/51	71 891	0,00
				250 000 USD	Eli Lilly & Co, 2.500%, 15/09/60	158 065	0,00
				100 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.375%, 14/09/61	69 117	0,00
				100 000 USD	EMD Finance LLC, 3.250%, 19/03/25	97 622	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
150 000 USD	Emerson Electric Co, 3.150%, 01/06/25	146 727	0,00	100 000 GBP	Equitable Financial Life Global Funding, 6.375%, 02/06/28	136 142	0,00
100 000 EUR	Emerson Electric Co, 1.250%, 15/10/25	106 835	0,00	105 000 USD	ERP Operating LP, 2.850%, 01/11/26	99 846	0,00
135 000 USD	Emerson Electric Co, 0.875%, 15/10/26	122 553	0,00	100 000 USD	ERP Operating LP, 3.250%, 01/08/27	95 209	0,00
1 000 000 USD	Enel Finance America LLC, 7.100%, 14/10/27	1 068 910	0,02	200 000 USD	ERP Operating LP, 1.850%, 01/08/31	164 410	0,00
100 000 USD	Entergy Arkansas LLC, 3.500%, 01/04/26	97 285	0,00	100 000 USD	ERP Operating LP, 4.000%, 01/08/47	80 566	0,00
500 000 USD	Entergy Arkansas LLC, 5.150%, 15/01/33	510 730	0,01	300 000 USD	Essential Utilities Inc, 3.566%, 01/05/29	280 650	0,00
1 000 000 USD	Entergy Arkansas LLC, 5.300%, 15/09/33	1 028 800	0,02	1 500 000 USD	Essential Utilities Inc, 3.351%, 15/04/50	1 070 580	0,02
2 095 000 USD	Entergy Arkansas LLC, 2.650%, 15/06/51	1 327 245	0,02	200 000 USD	Essex Portfolio LP, 4.000%, 01/03/29	191 030	0,00
200 000 USD	Entergy Arkansas LLC, 3.350%, 15/06/52	145 410	0,00	200 000 USD	Essex Portfolio LP, 1.650%, 15/01/31	159 120	0,00
120 000 USD	Entergy Corp, 0.900%, 15/09/25	111 725	0,00	100 000 USD	Estee Lauder Cos Inc, 3.150%, 15/03/27	95 877	0,00
30 000 USD	Entergy Corp, 2.950%, 01/09/26	28 498	0,00	50 000 USD	Estee Lauder Cos Inc, 4.375%, 15/06/45	45 398	0,00
425 000 USD	Entergy Louisiana LLC, 4.000%, 15/03/33	397 192	0,01	50 000 USD	Everest Reinsurance Holdings Inc, 3.500%, 15/10/50	37 001	0,00
5 000 USD	Entergy Louisiana LLC, 2.900%, 15/03/51	3 350	0,00	300 000 USD	Everest Reinsurance Holdings Inc, 3.125%, 15/10/52	206 160	0,00
165 000 USD	Entergy Texas Inc, 1.750%, 15/03/31	135 048	0,00	700 000 USD	Eversource Energy, 1.400%, 15/08/26	638 736	0,01
50 000 USD	Entergy Texas Inc, 3.550%, 30/09/49	37 983	0,00	500 000 USD	Eversource Energy, 5.950%, 01/02/29	524 645	0,01
2 000 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 5.050%, 10/01/26	2 020 200	0,03	50 000 USD	Eversource Energy, 4.250%, 01/04/29	48 610	0,00
75 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 4.150%, 16/10/28	74 234	0,00	125 000 USD	Eversource Energy, 3.450%, 15/01/50	90 824	0,00
100 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 3.125%, 31/07/29	93 633	0,00	50 000 USD	Exelon Corp, 3.400%, 15/04/26	48 437	0,00
360 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 2.800%, 31/01/30	326 426	0,01	800 000 USD	Exelon Corp, 2.750%, 15/03/27	753 696	0,01
1 000 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 5.350%, 31/01/33	1 049 490	0,02	525 000 USD	Exelon Corp, 5.625%, 15/06/35	542 204	0,01
25 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 6.125%, 15/10/39	27 414	0,00	50 000 USD	Exelon Corp, 4.450%, 15/04/46	43 625	0,00
130 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 5.950%, 01/02/41	140 180	0,00	100 000 USD	Xpedia Group Inc, 3.800%, 15/02/28	96 440	0,00
150 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 4.900%, 15/05/46	143 590	0,00	235 000 USD	Xpedia Group Inc, 3.250%, 15/02/30	215 692	0,00
75 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 4.800%, 01/02/49	71 262	0,00	300 000 USD	Xpedia Group Inc, 2.950%, 15/03/31	265 347	0,00
65 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 4.200%, 31/01/50	56 727	0,00	50 000 USD	Extra Space Storage LP, 3.875%, 15/12/27	47 941	0,00
600 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 3.700%, 31/01/51	480 432	0,01	545 000 USD	Extra Space Storage LP, 2.200%, 15/10/30	454 895	0,01
270 000 USD	Enterprise Products Operating LLC, 3.950%, 31/01/60	220 360	0,00	70 000 USD	Extra Space Storage LP, 2.350%, 15/03/32	57 135	0,00
200 000 USD	Equinix Inc, 1.000%, 15/09/25	186 784	0,00	100 000 USD	Exxon Mobil Corp, 3.043%, 01/03/26	97 137	0,00
100 000 USD	Equinix Inc, 1.550%, 15/03/28	87 991	0,00	100 000 USD	Exxon Mobil Corp, 2.275%, 16/08/26	95 212	0,00
500 000 USD	Equinix Inc, 2.000%, 15/05/28	447 100	0,01	100 000 USD	Exxon Mobil Corp, 2.440%, 16/08/29	91 066	0,00
1 000 000 USD	Equinix Inc, 3.900%, 15/04/32	930 520	0,01				
200 000 USD	Equinix Inc, 2.950%, 15/09/51	133 996	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
300 000 USD	Exxon Mobil Corp, 2.610%, 15/10/30	268 335	0,00	1 000 000 USD	Fifth Third Bancorp, 6.339%, 27/07/29	1 042 110	0,02
100 000 EUR	Exxon Mobil Corp, 0.835%, 26/06/32	91 473	0,00	200 000 USD	Fifth Third Bancorp, 8.250%, 01/03/38	237 200	0,00
100 000 EUR	Exxon Mobil Corp, 1.408%, 26/06/39	81 765	0,00	225 000 USD	Fiserv Inc, 3.200%, 01/07/26	216 630	0,00
100 000 USD	Exxon Mobil Corp, 2.995%, 16/08/39	80 554	0,00	100 000 USD	Fiserv Inc, 2.250%, 01/06/27	92 664	0,00
300 000 USD	Exxon Mobil Corp, 4.227%, 19/03/40	279 012	0,00	500 000 USD	Fiserv Inc, 5.450%, 02/03/28	515 660	0,01
165 000 USD	Exxon Mobil Corp, 4.114%, 01/03/46	147 531	0,00	100 000 USD	Fiserv Inc, 2.650%, 01/06/30	88 211	0,00
100 000 USD	Exxon Mobil Corp, 3.095%, 16/08/49	74 412	0,00	60 000 USD	Fiserv Inc, 4.400%, 01/07/49	52 943	0,00
400 000 USD	Exxon Mobil Corp, 4.327%, 19/03/50	366 252	0,01	200 000 EUR	Fiserv Inc, 4.500%, perpetual	234 435	0,00
200 000 USD	Exxon Mobil Corp, 3.452%, 15/04/51	157 758	0,00	175 000 USD	Florida Power & Light Co, 5.950%, 01/02/38	191 789	0,00
500 000 USD	FactSet Research Systems Inc, 2.900%, 01/03/27	469 380	0,01	1 000 000 USD	Ford Motor Credit Co LLC, 6.798%, 07/11/28	1 047 340	0,02
500 000 USD	Federal Realty OP LP, 5.375%, 01/05/28	505 770	0,01	3 000 000 USD	Ford Motor Credit Co LLC, 2.900%, 10/02/29	2 630 880	0,04
100 000 USD	Federal Realty OP LP, 3.200%, 15/06/29	90 998	0,00	1 000 000 USD	Ford Motor Credit Co LLC, 7.122%, 07/11/33	1 078 700	0,02
100 000 EUR	Fedex Corp, 1.300%, 05/08/31	97 554	0,00	400 000 USD	Fortive Corp, 3.150%, 15/06/26	383 092	0,01
100 000 EUR	FedEx Corp, 0.450%, 05/08/25	105 650	0,00	100 000 USD	Fox Corp, 3.050%, 07/04/25	97 368	0,00
100 000 EUR	FedEx Corp, 0.450%, 04/05/29	96 012	0,00	50 000 USD	Fox Corp, 3.500%, 08/04/30	46 200	0,00
665 000 USD	FedEx Corp, 2.400%, 15/05/31	572 518	0,01	1 000 000 USD	Fox Corp, 6.500%, 13/10/33	1 084 410	0,02
100 000 EUR	FedEx Corp, 0.950%, 04/05/33	87 181	0,00	300 000 USD	Fox Corp, 5.476%, 25/01/39	292 629	0,01
655 000 USD	FedEx Corp, 3.250%, 15/05/41	507 782	0,01	100 000 USD	Franklin Resources Inc, 2.850%, 30/03/25	97 326	0,00
150 000 USD	FedEx Corp, 4.750%, 15/11/45	138 427	0,00	50 000 USD	Franklin Resources Inc, 1.600%, 30/10/30	40 921	0,00
100 000 USD	FedEx Corp, 4.400%, 15/01/47	87 306	0,00	100 000 USD	FS KKR Capital Corp, 3.400%, 15/01/26	94 694	0,00
300 000 USD	FedEx Corp, 4.050%, 15/02/48	250 731	0,00	600 000 USD	FS KKR Capital Corp, 2.625%, 15/01/27	538 362	0,01
50 000 USD	Fidelity National Financial Inc, 4.500%, 15/08/28	48 733	0,00	500 000 USD	FS KKR Capital Corp, 7.875%, 15/01/29	530 765	0,01
200 000 USD	Fidelity National Financial Inc, 2.450%, 15/03/31	166 050	0,00	500 000 USD	GA Global Funding Trust, 1.625%, 15/01/26	460 010	0,01
300 000 USD	Fidelity National Financial Inc, 3.200%, 17/09/51	191 658	0,00	100 000 USD	GATX Corp, 3.250%, 15/09/26	95 415	0,00
525 000 USD	Fidelity National Information Services Inc, 1.150%, 01/03/26	485 368	0,01	125 000 USD	GATX Corp, 4.000%, 30/06/30	117 516	0,00
100 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 1.500%, 21/05/27	104 550	0,00	200 000 USD	GE Capital Funding LLC, 4.550%, 15/05/32	196 494	0,00
520 000 USD	Fidelity National Information Services Inc, 1.650%, 01/03/28	464 126	0,01	500 000 USD	GE HealthCare Technologies Inc, 5.905%, 22/11/32	533 685	0,01
100 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 1.000%, 03/12/28	99 675	0,00	1 500 000 USD	GE HealthCare Technologies Inc, 6.377%, 22/11/52	1 745 655	0,03
100 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 2.000%, 21/05/30	102 454	0,00	200 000 EUR	General Electric Co, 0.875%, 17/05/25	213 383	0,00
550 000 USD	Fidelity National Information Services Inc, 2.250%, 01/03/31	465 591	0,01	100 000 EUR	General Electric Co, 4.125%, 19/09/35	118 196	0,00
510 000 USD	Fidelity National Information Services Inc, 3.100%, 01/03/41	381 026	0,01	100 000 EUR	General Mills Inc, 0.450%, 15/01/26	104 219	0,00
500 000 USD	Fidelity National Information Services Inc, 5.625%, 15/07/52	512 405	0,01	100 000 USD	General Mills Inc, 3.200%, 10/02/27	95 793	0,00
150 000 USD	Fifth Third Bancorp, 2.550%, 05/05/27	138 210	0,00	300 000 USD	General Mills Inc, 4.200%, 17/04/28	295 785	0,01
				200 000 EUR	General Mills Inc, 3.907%, 13/04/29	227 947	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
500 000 USD	General Mills Inc, 2.250%, 14/10/31	420 775	0,01	500 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 6.400%, 09/01/33	533 230	0,01
800 000 USD	General Mills Inc, 3.000%, 01/02/51	559 448	0,01	50 000 USD	George Washington University, 4.300%, 15/09/44	44 027	0,00
70 000 USD	General Motors Co, 6.600%, 01/04/36	74 985	0,00	50 000 USD	Georgetown University, 2.943%, 01/04/50	34 890	0,00
100 000 USD	General Motors Co, 5.150%, 01/04/38	94 905	0,00	100 000 USD	Gilead Sciences Inc, 3.650%, 01/03/26	97 887	0,00
150 000 USD	General Motors Co, 5.200%, 01/04/45	135 451	0,00	100 000 USD	Gilead Sciences Inc, 2.950%, 01/03/27	95 285	0,00
50 000 USD	General Motors Co, 6.750%, 01/04/46	53 755	0,00	95 000 USD	Gilead Sciences Inc, 1.200%, 01/10/27	84 614	0,00
200 000 USD	General Motors Co, 5.400%, 01/04/48	183 540	0,00	80 000 USD	Gilead Sciences Inc, 1.650%, 01/10/30	67 103	0,00
200 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 4.000%, 15/01/25	196 734	0,00	100 000 USD	Gilead Sciences Inc, 4.600%, 01/09/35	98 848	0,00
200 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 2.900%, 26/02/25	194 122	0,00	200 000 USD	Gilead Sciences Inc, 2.600%, 01/10/40	147 648	0,00
100 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 1.694%, 26/03/25	107 682	0,00	100 000 USD	Gilead Sciences Inc, 4.800%, 01/04/44	96 726	0,00
1 500 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 3.800%, 07/04/25	1 469 940	0,02	50 000 USD	Gilead Sciences Inc, 4.750%, 01/03/46	47 817	0,00
40 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 4.350%, 09/04/25	39 435	0,00	75 000 USD	Gilead Sciences Inc, 4.150%, 01/03/47	65 459	0,00
200 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 2.750%, 20/06/25	192 516	0,00	200 000 USD	Gilead Sciences Inc, 2.800%, 01/10/50	138 448	0,00
500 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 1.250%, 08/01/26	462 775	0,01	300 000 USD	GlaxoSmithKline Capital Inc, 3.625%, 15/05/25	295 005	0,01
500 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 1.500%, 10/06/26	458 465	0,01	210 000 USD	GlaxoSmithKline Capital Inc, 5.375%, 15/04/34	226 735	0,00
300 000 GBP	General Motors Financial Co Inc, 5.150%, 15/08/26	384 371	0,01	190 000 USD	Global Payments Inc, 1.200%, 01/03/26	174 638	0,00
50 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 4.000%, 06/10/26	48 671	0,00	100 000 USD	Global Payments Inc, 4.450%, 01/06/28	97 437	0,00
100 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 4.350%, 17/01/27	98 111	0,00	140 000 USD	Global Payments Inc, 2.900%, 15/05/30	123 355	0,00
500 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 5.000%, 09/04/27	499 125	0,01	200 000 USD	Globe Life Inc, 2.150%, 15/08/30	167 690	0,00
300 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 0.600%, 20/05/27	302 849	0,01	25 000 USD	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5.250%, 01/06/25	24 940	0,00
200 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 2.700%, 20/08/27	184 600	0,00	55 000 USD	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5.375%, 15/04/26	54 740	0,00
1 000 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 6.000%, 09/01/28	1 035 480	0,02	25 000 USD	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5.750%, 01/06/28	25 203	0,00
600 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 2.400%, 10/04/28	539 220	0,01	65 000 USD	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 4.000%, 15/01/30	59 183	0,00
1 000 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 5.800%, 23/06/28	1 028 940	0,02	100 000 USD	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 4.000%, 15/01/31	90 049	0,00
500 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 2.400%, 15/10/28	444 490	0,01	300 000 USD	Goldman Sachs BDC Inc, 3.750%, 10/02/25	293 613	0,01
2 000 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 4.300%, 06/04/29	1 930 960	0,03	200 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.500%, 23/01/25	196 212	0,00
500 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 5.850%, 06/04/30	516 535	0,01	400 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 3.375%, 27/03/25	440 959	0,01
400 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 3.600%, 21/06/30	364 124	0,01	200 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 4.250%, 21/10/25	196 320	0,00
500 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 3.100%, 12/01/32	426 600	0,01	100 000 GBP	Goldman Sachs Group Inc, 4.250%, 29/01/26	126 204	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
665 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 0.855%, 12/02/26	630 413	0,01	300 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 4.017%, 31/10/38	262 275	0,00
1 000 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 5.798%, 10/08/26	1 010 340	0,02	300 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 4.411%, 23/04/39	272 325	0,00
150 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.500%, 16/11/26	144 553	0,00	450 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 6.250%, 01/02/41	502 321	0,01
200 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 1.093%, 09/12/26	184 338	0,00	500 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.210%, 22/04/42	383 755	0,01
300 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 5.950%, 15/01/27	308 637	0,01	500 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 2.908%, 21/07/42	365 830	0,01
200 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.850%, 26/01/27	194 626	0,00	100 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.436%, 24/02/43	78 460	0,00
660 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 1.431%, 09/03/27	608 619	0,01	50 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 4.750%, 21/10/45	47 617	0,00
500 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 1.948%, 21/10/27	457 555	0,01	100 000 USD	Guardian Life Insurance Co of America, 4.875%, 19/06/64	90 757	0,00
800 000 CAD	Goldman Sachs Group Inc, 2.599%, 30/11/27	572 152	0,01	200 000 USD	Hackensack Meridian Health Inc, 2.675%, 01/09/41	143 192	0,00
100 000 GBP	Goldman Sachs Group Inc, 1.500%, 07/12/27	113 939	0,00	300 000 USD	Halliburton Co, 2.920%, 01/03/30	270 279	0,00
65 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.250%, 26/01/28	63 584	0,00	100 000 USD	Halliburton Co, 6.700%, 15/09/38	117 241	0,00
90 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 2.640%, 24/02/28	83 423	0,00	200 000 USD	Halliburton Co, 7.450%, 15/09/39	250 396	0,00
200 000 CHF	Goldman Sachs Group Inc, 0.400%, 11/05/28	223 872	0,00	55 000 USD	Hanover Insurance Group Inc, 2.500%, 01/09/30	45 283	0,00
135 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.691%, 05/06/28	129 165	0,00	300 000 USD	Harley-Davidson Financial Services Inc, 3.350%, 08/06/25	289 617	0,01
160 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 2.000%, 01/11/28	167 094	0,00	500 000 USD	Harley-Davidson Financial Services Inc, 3.050%, 14/02/27	465 370	0,01
500 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.250%, 07/02/29	494 204	0,01	500 000 USD	Harley-Davidson Financial Services Inc, 6.500%, 10/03/28	519 640	0,01
300 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.875%, 09/05/29	288 118	0,01	450 000 USD	Hartford Financial Services Group Inc, 6.100%, 01/10/41	483 084	0,01
255 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 4.000%, 21/09/29	290 672	0,01	200 000 USD	Hartford Financial Services Group Inc, 2.900%, 15/09/51	134 776	0,00
50 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.875%, 21/01/30	47 526	0,00	60 000 USD	Hasbro Inc, 3.500%, 15/09/27	56 591	0,00
365 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 2.600%, 07/02/30	320 934	0,01	100 000 USD	Hasbro Inc, 3.900%, 19/11/29	93 233	0,00
100 000 GBP	Goldman Sachs Group Inc, 1.875%, 16/12/30	106 247	0,00	75 000 USD	HCA Inc, 5.250%, 15/04/25	74 991	0,00
60 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.750%, 23/03/32	52 958	0,00	75 000 USD	HCA Inc, 5.250%, 15/06/26	75 306	0,00
5 000 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 2.383%, 21/07/32	4 107 450	0,06	65 000 USD	HCA Inc, 4.500%, 15/02/27	64 126	0,00
500 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 2.650%, 21/10/32	417 255	0,01	500 000 USD	HCA Inc, 3.125%, 15/03/27	474 340	0,01
200 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.102%, 24/02/33	171 936	0,00	500 000 USD	HCA Inc, 5.200%, 01/06/28	505 445	0,01
80 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.000%, 18/03/33	70 197	0,00	235 000 USD	HCA Inc, 4.125%, 15/06/29	225 048	0,00
80 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 6.450%, 01/05/36	86 662	0,00	225 000 USD	HCA Inc, 5.125%, 15/06/39	214 364	0,00
200 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 6.750%, 01/10/37	220 924	0,00	2 000 000 USD	HCA Inc, 4.375%, 15/03/42	1 696 680	0,03
150 000 GBP	Goldman Sachs Group Inc, 6.875%, 18/01/38	210 759	0,00	75 000 USD	HCA Inc, 5.500%, 15/06/47	72 343	0,00
				100 000 USD	HCA Inc, 5.250%, 15/06/49	93 186	0,00
				800 000 USD	HCA Inc, 4.625%, 15/03/52	684 224	0,01
				200 000 USD	Healthcare Realty Holdings LP, 3.750%, 01/07/27	189 494	0,00
				115 000 USD	Healthpeak OP LLC, 3.500%, 15/07/29	107 335	0,00
				200 000 USD	Healthpeak OP LLC, 3.000%, 15/01/30	178 324	0,00
				455 000 USD	Hershey Co, 1.700%, 01/06/30	387 059	0,01
				300 000 USD	Hershey Co, 2.650%, 01/06/50	208 023	0,00
				50 000 USD	Hess Corp, 4.300%, 01/04/27	49 546	0,00
				15 000 USD	Hess Corp, 7.300%, 15/08/31	17 341	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
25 000 USD	Hess Corp, 7.125%, 15/03/33	28 955	0,00	300 000 USD	Hormel Foods Corp, 3.050%, 03/06/51	217 293	0,00
50 000 USD	Hess Corp, 5.600%, 15/02/41	52 637	0,00	500 000 USD	Host Hotels & Resorts LP, 2.900%, 15/12/31	420 730	0,01
50 000 USD	Hess Corp, 5.800%, 01/04/47	54 085	0,00	200 000 USD	HP Inc, 2.200%, 17/06/25	191 680	0,00
150 000 USD	Hewlett Packard Enterprise Co, 4.900%, 15/10/25	149 436	0,00	500 000 USD	HP Inc, 4.750%, 15/01/28	501 195	0,01
550 000 USD	Hewlett Packard Enterprise Co, 1.750%, 01/04/26	512 396	0,01	100 000 USD	HP Inc, 6.000%, 15/09/41	105 789	0,00
50 000 USD	Hewlett Packard Enterprise Co, 6.200%, 15/10/35	55 053	0,00	615 000 USD	Hubbell Inc, 2.300%, 15/03/31	517 381	0,01
50 000 USD	Hewlett Packard Enterprise Co, 6.350%, 15/10/45	54 188	0,00	300 000 USD	Hudson Pacific Properties LP, 3.250%, 15/01/30	225 339	0,00
590 000 USD	HF Sinclair Corp, 4.500%, 01/10/30	552 305	0,01	1 000 000 USD	Humana Inc, 5.750%, 01/03/28	1 040 900	0,02
100 000 USD	Highwoods Realty LP, 3.050%, 15/02/30	82 888	0,00	500 000 USD	Humana Inc, 5.750%, 01/12/28	522 495	0,01
500 000 USD	Hill City Funding Trust, 4.046%, 15/08/41	370 950	0,01	300 000 USD	Humana Inc, 3.700%, 23/03/29	288 600	0,01
20 000 USD	Home Depot Inc, 3.350%, 15/09/25	19 622	0,00	75 000 USD	Humana Inc, 3.125%, 15/08/29	69 632	0,00
100 000 USD	Home Depot Inc, 3.000%, 01/04/26	96 988	0,00	100 000 USD	Humana Inc, 4.800%, 15/03/47	93 170	0,00
100 000 USD	Home Depot Inc, 2.800%, 14/09/27	95 213	0,00	105 000 USD	Humana Inc, 3.950%, 15/08/49	86 813	0,00
365 000 USD	Home Depot Inc, 0.900%, 15/03/28	319 674	0,01	500 000 USD	Humana Inc, 5.500%, 15/03/53	519 320	0,01
500 000 USD	Home Depot Inc, 1.500%, 15/09/28	443 695	0,01	45 000 USD	Huntsman International LLC, 4.500%, 01/05/29	43 437	0,00
40 000 USD	Home Depot Inc, 3.900%, 06/12/28	39 406	0,00	500 000 USD	Huntsman International LLC, 2.950%, 15/06/31	425 400	0,01
185 000 USD	Home Depot Inc, 2.950%, 15/06/29	174 264	0,00	50 000 USD	Hyatt Hotels Corp, 4.375%, 15/09/28	48 571	0,00
300 000 USD	Home Depot Inc, 2.700%, 15/04/30	273 579	0,00	300 000 USD	Hyundai Capital America, 2.650%, 10/02/25	291 111	0,01
500 000 USD	Home Depot Inc, 1.375%, 15/03/31	409 160	0,01	500 000 USD	Hyundai Capital America, 1.650%, 17/09/26	454 810	0,01
500 000 USD	Home Depot Inc, 3.250%, 15/04/32	462 565	0,01	500 000 USD	Hyundai Capital America, 5.600%, 30/03/28	507 620	0,01
100 000 USD	Home Depot Inc, 5.875%, 16/12/36	112 016	0,00	600 000 USD	IDEX Corp, 2.625%, 15/06/31	512 370	0,01
100 000 USD	Home Depot Inc, 5.400%, 15/09/40	105 770	0,00	300 000 USD	Illinois Tool Works Inc, 2.650%, 15/11/26	286 479	0,00
300 000 USD	Home Depot Inc, 3.900%, 15/06/47	258 702	0,00	100 000 EUR	Illinois Tool Works Inc, 0.625%, 05/12/27	101 626	0,00
100 000 USD	Home Depot Inc, 4.500%, 06/12/48	94 575	0,00	300 000 EUR	Illinois Tool Works Inc, 1.000%, 05/06/31	291 654	0,01
150 000 USD	Home Depot Inc, 3.125%, 15/12/49	112 032	0,00	200 000 USD	Illinois Tool Works Inc, 3.900%, 01/09/42	179 576	0,00
200 000 USD	Home Depot Inc, 2.375%, 15/03/51	127 296	0,00	300 000 USD	Infor Inc, 1.750%, 15/07/25	283 188	0,00
500 000 USD	Home Depot Inc, 2.750%, 15/09/51	343 685	0,01	1 000 000 USD	Ingersoll Rand Inc, 5.400%, 14/08/28	1 031 380	0,02
100 000 USD	Home Depot Inc, 3.500%, 15/09/56	79 131	0,00	50 000 USD	Ingredion Inc, 3.200%, 01/10/26	47 851	0,00
500 000 USD	Hormel Foods Corp, 1.700%, 03/06/28	450 495	0,01	300 000 USD	Intel Corp, 3.400%, 25/03/25	294 975	0,01
500 000 USD	Hormel Foods Corp, 1.800%, 11/06/30	425 645	0,01	145 000 USD	Intel Corp, 3.700%, 29/07/25	142 741	0,00
				250 000 USD	Intel Corp, 2.450%, 15/11/29	225 407	0,00
				300 000 USD	Intel Corp, 3.900%, 25/03/30	290 955	0,01
				600 000 USD	Intel Corp, 2.800%, 12/08/41	451 506	0,01
				1 000 000 USD	Intel Corp, 5.625%, 10/02/43	1 071 540	0,02
				100 000 USD	Intel Corp, 4.100%, 11/05/47	87 375	0,00
				200 000 USD	Intel Corp, 3.734%, 08/12/47	163 522	0,00
				600 000 USD	Intel Corp, 4.750%, 25/03/50	570 276	0,01
				500 000 USD	Intel Corp, 5.700%, 10/02/53	542 410	0,01
				500 000 USD	Intel Corp, 3.200%, 12/08/61	346 800	0,01
				500 000 AUD	Inter-American Development Bank, 4.700%, 03/10/23	345 272	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
300 000 GBP	Inter-American Development Bank, 2.375%, 03/08/29	358 036	0,01	100 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.250%, 09/02/34	92 395	0,00
2 000 000 USD	Inter-American Development Bank, 3.500%, 14/09/29	1 952 060	0,03	500 000 EUR	International Business Machines Corp, 3.750%, 06/02/35	576 274	0,01
500 000 USD	Inter-American Development Bank, 1.500%, perpetual	463 345	0,01	100 000 GBP	International Business Machines Corp, 4.875%, 06/02/38	126 530	0,00
95 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 3.650%, 23/05/25	93 216	0,00	300 000 USD	International Business Machines Corp, 4.150%, 15/05/39	273 288	0,00
700 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 4.000%, 15/09/27	688 037	0,01	100 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.200%, 11/02/40	80 236	0,00
85 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 4.350%, 15/06/29	84 748	0,00	100 000 USD	International Business Machines Corp, 4.000%, 20/06/42	87 468	0,00
65 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 2.100%, 15/06/30	56 233	0,00	100 000 USD	International Business Machines Corp, 4.700%, 19/02/46	94 721	0,00
55 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 4.600%, 15/03/33	54 922	0,00	200 000 USD	International Business Machines Corp, 4.250%, 15/05/49	175 848	0,00
135 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 2.650%, 15/09/40	100 999	0,00	190 000 USD	International Business Machines Corp, 3.430%, 09/02/52	142 352	0,00
250 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 4.250%, 21/09/48	225 142	0,00	500 000 USD	International Business Machines Corp, 5.100%, 06/02/53	502 050	0,01
45 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 3.000%, 15/06/50	32 321	0,00	100 000 GBP	International Development Association, 4.750%, 14/10/31	136 220	0,00
95 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 4.950%, 15/06/52	95 296	0,00	200 000 GBP	International Finance Corp, 4.500%, 02/10/28	263 873	0,00
640 000 USD	Intercontinental Exchange Inc, 5.200%, 15/06/62	657 190	0,01	500 000 EUR	International Flavors & Fragrances Inc, 1.800%, 25/09/26	524 659	0,01
500 000 GBP	International Bank for Reconstruction & Development, 1.250%, 13/12/28	568 376	0,01	45 000 USD	International Flavors & Fragrances Inc, 4.450%, 26/09/28	43 950	0,00
200 000 CAD	International Bank for Reconstruction & Development, 1.800%, perpetual	143 311	0,00	600 000 USD	Interpublic Group of Cos Inc, 2.400%, 01/03/31	508 452	0,01
100 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.875%, 31/01/25	107 274	0,00	500 000 USD	Interpublic Group of Cos Inc, 5.375%, 15/06/33	509 140	0,01
1 000 000 USD	International Business Machines Corp, 4.500%, 06/02/26	997 500	0,02	570 000 USD	Interpublic Group of Cos Inc, 3.375%, 01/03/41	435 679	0,01
100 000 USD	International Business Machines Corp, 3.450%, 19/02/26	97 465	0,00	365 000 USD	Intuit Inc, 0.950%, 15/07/25	343 980	0,01
100 000 USD	International Business Machines Corp, 3.300%, 15/05/26	97 037	0,00	500 000 USD	Invitation Homes Operating Partnership LP, 2.300%, 15/11/28	445 530	0,01
300 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.250%, 29/01/27	314 842	0,01	500 000 USD	Invitation Homes Operating Partnership LP, 4.150%, 15/04/32	461 430	0,01
610 000 USD	International Business Machines Corp, 2.200%, 09/02/27	568 514	0,01	1 000 000 USD	Invitation Homes Operating Partnership LP, 5.500%, 15/08/33	1 002 480	0,02
300 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.300%, 11/02/28	298 541	0,01	500 000 USD	Invitation Homes Operating Partnership LP, 2.700%, 15/01/34	401 945	0,01
255 000 USD	International Business Machines Corp, 3.500%, 15/05/29	243 390	0,00	500 000 USD	IQVIA Inc, 6.250%, 01/02/29	522 485	0,01
100 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.500%, 23/05/29	102 850	0,00	1 000 000 USD	ITC Holdings Corp, 4.950%, 22/09/27	1 004 880	0,02
100 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.875%, 09/02/30	97 720	0,00	125 000 USD	J M Smucker Co, 2.375%, 15/03/30	108 128	0,00
100 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.750%, 31/01/31	101 351	0,00	500 000 USD	J M Smucker Co, 2.750%, 15/09/41	349 940	0,01
230 000 USD	International Business Machines Corp, 2.720%, 09/02/32	202 761	0,00	1 000 000 USD	J M Smucker Co, 6.500%, 15/11/43	1 118 650	0,02
200 000 USD	International Business Machines Corp, 5.875%, 29/11/32	219 192	0,00	100 000 USD	J M Smucker Co, 4.375%, 15/03/45	88 692	0,00
				1 000 000 USD	J M Smucker Co, 6.500%, 15/11/53	1 156 500	0,02
				500 000 USD	Jabil Inc, 1.700%, 15/04/26	463 030	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
55 000 USD	Jabil Inc, 3.950%, 12/01/28	52 507	0,00	200 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.950%, 01/10/26	190 776	0,00
500 000 USD	Jabil Inc, 5.450%, 01/02/29	511 100	0,01	15 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 7.625%, 15/10/26	16 138	0,00
550 000 USD	Jabil Inc, 3.000%, 15/01/31	477 746	0,01	200 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.500%, 29/10/26	211 680	0,00
500 000 USD	Jackson National Life Global Funding, 1.750%, 12/01/25	478 835	0,01	100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 1.045%, 19/11/26	92 622	0,00
100 000 USD	JB Hunt Transport Services Inc, 3.875%, 01/03/26	97 880	0,00	250 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.960%, 29/01/27	244 272	0,00
100 000 USD	Jefferies Financial Group Inc, 4.150%, 23/01/30	94 039	0,00	300 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.090%, 11/03/27	314 832	0,01
500 000 USD	Jefferies Financial Group Inc, 2.625%, 15/10/31	415 550	0,01	435 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 1.578%, 22/04/27	401 540	0,01
108 498 USD	JetBlue 2020-1 Class A Pass Through Trust, 4.000%, 15/11/32	98 909	0,00	715 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 1.470%, 22/09/27	647 697	0,01
300 000 USD	John Deere Capital Corp, 2.050%, 09/01/25	291 708	0,01	200 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.625%, 01/12/27	191 860	0,00
100 000 USD	John Deere Capital Corp, 3.450%, 13/03/25	98 492	0,00	400 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 0.389%, 24/02/28	402 552	0,01
500 000 USD	John Deere Capital Corp, 4.950%, 06/06/25	502 225	0,01	200 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.540%, 01/05/28	191 070	0,00
500 000 USD	John Deere Capital Corp, 0.700%, 15/01/26	463 675	0,01	100 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.638%, 18/05/28	104 346	0,00
1 000 000 USD	John Deere Capital Corp, 4.750%, 08/06/26	1 007 310	0,02	400 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.182%, 01/06/28	365 792	0,01
100 000 USD	John Deere Capital Corp, 2.650%, 10/06/26	95 750	0,00	100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.005%, 23/04/29	96 280	0,00
500 000 USD	John Deere Capital Corp, 1.300%, 13/10/26	460 010	0,01	640 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.069%, 01/06/29	568 019	0,01
300 000 USD	John Deere Capital Corp, 2.350%, 08/03/27	282 294	0,00	100 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.812%, 12/06/29	103 315	0,00
150 000 USD	John Deere Capital Corp, 2.800%, 08/09/27	142 248	0,00	300 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.203%, 23/07/29	291 684	0,01
1 000 000 USD	John Deere Capital Corp, 4.950%, 14/07/28	1 025 230	0,02	1 000 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 5.299%, 24/07/29	1 015 520	0,02
100 000 USD	John Deere Capital Corp, 3.450%, 07/03/29	96 039	0,00	1 000 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 6.087%, 23/10/29	1 051 930	0,02
1 000 000 USD	John Deere Capital Corp, 3.350%, 18/04/29	958 930	0,02	300 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.963%, 23/03/30	308 681	0,01
300 000 USD	John Deere Capital Corp, 2.450%, 09/01/30	270 936	0,00	250 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.702%, 06/05/30	235 400	0,00
500 000 USD	John Deere Capital Corp, 3.400%, perpetual	492 035	0,01	140 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.565%, 14/06/30	137 098	0,00
50 000 USD	Johns Hopkins Health System Corp, 3.837%, 15/05/46	42 492	0,00	245 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.956%, 13/05/31	215 585	0,00
500 000 EUR	Johnson Controls International PLC / Tyco Fire & Security Finance SCA, 3.000%, 15/09/28	550 066	0,01	100 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.001%, 25/07/31	94 255	0,00
200 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.125%, 23/01/25	195 890	0,00	500 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 4.457%, 13/11/31	582 206	0,01
200 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.500%, 27/01/25	215 502	0,00	100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 1.764%, 19/11/31	81 166	0,00
100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.300%, 01/04/26	96 737	0,00	155 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.580%, 22/04/32	131 338	0,00
500 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.080%, 26/04/26	492 045	0,01	500 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.545%, 08/11/32	418 340	0,01
200 000 GBP	JPMorgan Chase & Co, 0.991%, 28/04/26	240 833	0,00	100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.963%, 25/01/33	85 795	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 0.597%, 17/02/33	88 827	0,00	500 000 USD	KeyBank NA/Cleveland OH, 5.850%, 15/11/27	500 290	0,01
1 000 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.586%, 26/04/33	966 890	0,02	100 000 USD	KeyBank NA/Cleveland OH, 4.390%, 14/12/27	93 960	0,00
100 000 GBP	JPMorgan Chase & Co, 1.895%, 28/04/33	104 353	0,00	1 000 000 USD	KeyBank NA/Cleveland OH, 5.000%, 26/01/33	937 170	0,01
1 000 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 5.350%, 01/06/34	1 015 150	0,02	95 000 USD	KeyCorp, 4.150%, 29/10/25	92 688	0,00
175 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 6.400%, 15/05/38	200 826	0,00	100 000 USD	KeyCorp, 2.250%, 06/04/27	90 113	0,00
300 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.882%, 24/07/38	266 649	0,00	250 000 USD	KeyCorp, 2.550%, 01/10/29	212 710	0,00
300 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 5.500%, 15/10/40	313 164	0,01	165 000 USD	Keysight Technologies Inc, 4.600%, 06/04/27	164 568	0,00
100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.525%, 19/11/41	71 117	0,00	100 000 USD	KeySpan Gas East Corp, 2.742%, 15/08/26	93 173	0,00
200 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 5.400%, 06/01/42	207 826	0,00	100 000 USD	Kilroy Realty LP, 4.250%, 15/08/29	92 006	0,00
200 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.157%, 22/04/42	155 388	0,00	100 000 USD	Kilroy Realty LP, 2.500%, 15/11/32	75 999	0,00
200 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 5.625%, 16/08/43	209 938	0,00	50 000 USD	Kimberly-Clark Corp, 1.050%, 15/09/27	44 664	0,00
100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.850%, 01/02/44	98 188	0,00	40 000 USD	Kimberly-Clark Corp, 3.950%, 01/11/28	39 448	0,00
200 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.260%, 22/02/48	177 622	0,00	100 000 USD	Kimberly-Clark Corp, 3.200%, 25/04/29	94 888	0,00
100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.032%, 24/07/48	85 507	0,00	25 000 USD	Kimberly-Clark Corp, 6.625%, 01/08/37	29 815	0,00
320 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.964%, 15/11/48	269 536	0,00	100 000 USD	Kimberly-Clark Corp, 3.900%, 04/05/47	84 990	0,00
635 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.328%, 22/04/52	476 891	0,01	500 000 USD	Kimco Realty OP LLC, 2.700%, 01/10/30	434 170	0,01
125 000 USD	Juniper Networks Inc, 2.000%, 10/12/30	101 184	0,00	100 000 USD	Kimco Realty OP LLC, 4.450%, 01/09/47	83 327	0,00
500 000 USD	Kaiser Foundation Hospitals, 2.810%, perpetual	377 475	0,01	200 000 USD	Kinder Morgan Energy Partners LP, 7.300%, 15/08/33	227 718	0,00
125 000 USD	Kaiser Foundation Hospitals, 3.150%, 01/05/27	119 708	0,00	35 000 USD	Kinder Morgan Energy Partners LP, 5.800%, 15/03/35	35 741	0,00
100 000 USD	Kaiser Foundation Hospitals, 4.150%, 01/05/47	88 681	0,00	100 000 USD	Kinder Morgan Energy Partners LP, 5.000%, 15/08/42	90 167	0,00
300 000 USD	Kaiser Foundation Hospitals, 3.266%, 01/11/49	226 749	0,00	150 000 USD	Kinder Morgan Energy Partners LP, 5.400%, 01/09/44	140 971	0,00
30 000 USD	Kellanova, 3.250%, 01/04/26	29 057	0,00	300 000 USD	Kinder Morgan Inc, 4.300%, 01/03/28	296 667	0,01
330 000 USD	Kellanova, 2.100%, 01/06/30	283 896	0,00	555 000 USD	Kinder Morgan Inc, 2.000%, 15/02/31	461 122	0,01
1 000 000 USD	Kellanova, 5.250%, 01/03/33	1 026 080	0,02	170 000 USD	Kinder Morgan Inc, 5.300%, 01/12/34	169 587	0,00
50 000 USD	Kellanova, 4.500%, 01/04/46	44 941	0,00	590 000 USD	Kinder Morgan Inc, 3.250%, 01/08/50	396 409	0,01
100 000 USD	Kemper Corp, 2.400%, 30/09/30	78 253	0,00	200 000 USD	Kite Realty Group Trust, 4.750%, 15/09/30	188 866	0,00
300 000 USD	Kennametal Inc, 2.800%, 01/03/31	253 335	0,00	50 000 USD	KLA Corp, 3.300%, 01/03/50	38 355	0,00
500 000 USD	Kenvue Inc, 5.100%, 22/03/43	520 600	0,01	300 000 USD	Kraft Heinz Foods Co, 3.875%, 15/05/27	294 492	0,01
280 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 4.597%, 25/05/28	280 596	0,00	200 000 USD	Kroger Co, 3.500%, 01/02/26	194 810	0,00
1 500 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 4.050%, 15/04/32	1 442 640	0,02	200 000 USD	Kroger Co, 4.450%, 01/02/47	177 342	0,00
60 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 4.500%, 15/11/45	54 546	0,00	250 000 USD	Kroger Co, 3.950%, 15/01/50	204 855	0,00
500 000 USD	KeyBank NA/Cleveland OH, 4.150%, 08/08/25	485 300	0,01	500 000 USD	Kyndryl Holdings Inc, 3.150%, 15/10/31	420 215	0,01
				1 000 000 USD	Kyndryl Holdings Inc, 4.100%, 15/10/41	755 240	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 USD	Laboratory Corp of America Holdings, 3.600%, 01/02/25	98 307	0,00	129 000 USD	Lowe's Cos Inc, 4.050%, 03/05/47	106 581	0,00
200 000 USD	Laboratory Corp of America Holdings, 3.600%, 01/09/27	193 290	0,00	80 000 USD	Lowe's Cos Inc, 3.000%, 15/10/50	54 511	0,00
600 000 USD	Laboratory Corp of America Holdings, 2.700%, 01/06/31	516 366	0,01	500 000 USD	Lowe's Cos Inc, 3.500%, 01/04/51	373 830	0,01
25 000 USD	Laboratory Corp of America Holdings, 4.700%, 01/02/45	23 115	0,00	500 000 USD	Lowe's Cos Inc, 5.625%, 15/04/53	525 205	0,01
50 000 USD	Lam Research Corp, 3.750%, 15/03/26	49 121	0,00	1 000 000 USD	Lowe's Cos Inc, 5.750%, 01/07/53	1 064 150	0,02
30 000 USD	Lam Research Corp, 4.000%, 15/03/29	29 632	0,00	1 000 000 USD	Lowe's Cos Inc, 5.850%, 01/04/63	1 054 360	0,02
100 000 USD	Lam Research Corp, 1.900%, 15/06/30	86 175	0,00	500 000 USD	LPL Holdings Inc, 4.625%, 15/11/27	482 375	0,01
25 000 USD	Lam Research Corp, 4.875%, 15/03/49	25 005	0,00	500 000 USD	LPL Holdings Inc, 6.750%, 17/11/28	532 955	0,01
70 000 USD	Lam Research Corp, 2.875%, 15/06/50	50 107	0,00	500 000 USD	LPL Holdings Inc, 4.000%, 15/03/29	460 095	0,01
85 000 USD	Lam Research Corp, 3.125%, 15/06/60	59 193	0,00	500 000 USD	LXP Industrial Trust, 6.750%, 15/11/28	525 905	0,01
50 000 USD	Lazard Group LLC, 3.750%, 13/02/25	48 881	0,00	20 000 USD	LYB International Finance III LLC, 1.250%, 01/10/25	18 689	0,00
100 000 USD	Lazard Group LLC, 3.625%, 01/03/27	94 349	0,00	25 000 USD	LYB International Finance III LLC, 2.250%, 01/10/30	21 382	0,00
200 000 USD	Lazard Group LLC, 4.375%, 11/03/29	194 702	0,00	30 000 USD	LYB International Finance III LLC, 3.375%, 01/10/40	23 104	0,00
150 000 USD	Lear Corp, 3.800%, 15/09/27	144 721	0,00	350 000 USD	LYB International Finance III LLC, 4.200%, 15/10/49	280 248	0,00
200 000 USD	Lear Corp, 4.250%, 15/05/29	192 438	0,00	40 000 USD	LYB International Finance III LLC, 3.625%, 01/04/51	29 144	0,00
50 000 USD	Leggett & Platt Inc, 3.500%, 15/11/27	47 236	0,00	30 000 USD	LYB International Finance III LLC, 3.800%, 01/10/60	21 410	0,00
50 000 USD	Leggett & Platt Inc, 4.400%, 15/03/29	48 508	0,00	1 000 000 USD	M&T Bank Corp, 5.053%, 27/01/34	948 590	0,01
500 000 USD	Leggett & Platt Inc, 3.500%, 15/11/51	360 570	0,01	100 000 USD	Magellan Midstream Partners LP, 5.000%, 01/03/26	99 807	0,00
100 000 USD	Leland Stanford Junior University, 3.647%, 01/05/48	86 484	0,00	100 000 USD	Magellan Midstream Partners LP, 4.200%, 03/10/47	79 613	0,00
100 000 USD	Liberty Mutual Group Inc, 3.950%, 15/05/60	72 456	0,00	100 000 EUR	ManpowerGroup Inc, 1.750%, 22/06/26	106 856	0,00
500 000 USD	Liberty Mutual Group Inc, 5.500%, perpetual	493 815	0,01	100 000 EUR	ManpowerGroup Inc, 3.500%, perpetual	110 601	0,00
35 000 USD	Lincoln National Corp, 3.800%, 01/03/28	33 635	0,00	15 000 USD	Marathon Oil Corp, 6.800%, 15/03/32	16 285	0,00
200 000 USD	Lincoln National Corp, 3.050%, 15/01/30	176 922	0,00	25 000 USD	Marathon Oil Corp, 6.600%, 01/10/37	26 519	0,00
25 000 USD	Lincoln National Corp, 4.350%, 01/03/48	19 918	0,00	100 000 USD	Marathon Oil Corp, 5.200%, 01/06/45	88 791	0,00
50 000 USD	Linde Inc/CT, 2.650%, 05/02/25	48 776	0,00	50 000 USD	Marathon Petroleum Corp, 5.125%, 15/12/26	50 574	0,00
15 000 USD	Loews Corp, 3.200%, 15/05/30	13 765	0,00	30 000 USD	Marathon Petroleum Corp, 3.800%, 01/04/28	28 693	0,00
500 000 USD	Lowe's Cos Inc, 3.350%, 01/04/27	482 150	0,01	150 000 USD	Marathon Petroleum Corp, 4.750%, 15/09/44	134 685	0,00
110 000 USD	Lowe's Cos Inc, 1.300%, 15/04/28	96 773	0,00	25 000 USD	Marathon Petroleum Corp, 4.500%, 01/04/48	21 027	0,00
525 000 USD	Lowe's Cos Inc, 1.700%, 15/09/28	463 984	0,01	65 000 USD	Markel Group Inc, 5.000%, 20/05/49	60 303	0,00
100 000 USD	Lowe's Cos Inc, 3.650%, 05/04/29	96 456	0,00	135 000 USD	Markel Group Inc, 3.450%, 07/05/52	96 609	0,00
110 000 USD	Lowe's Cos Inc, 1.700%, 15/10/30	91 568	0,00	500 000 USD	Marriott International Inc, 5.750%, 01/05/25	503 195	0,01
400 000 USD	Lowe's Cos Inc, 2.625%, 01/04/31	351 144	0,01				
500 000 USD	Lowe's Cos Inc, 3.750%, 01/04/32	468 290	0,01				
550 000 USD	Lowe's Cos Inc, 2.800%, 15/09/41	401 731	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
500 000 USD	Marriott International Inc, 4.900%, 15/04/29	503 650	0,01	25 000 USD	McDonald's Corp, 3.800%, 01/04/28	24 403	0,00
115 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 3.500%, 10/03/25	112 970	0,00	500 000 USD	McDonald's Corp, 4.800%, 14/08/28	509 780	0,01
25 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 3.750%, 14/03/26	24 552	0,00	400 000 EUR	McDonald's Corp, 0.250%, 04/10/28	389 597	0,01
400 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 4.750%, 15/03/39	389 768	0,01	100 000 EUR	McDonald's Corp, 2.375%, 31/05/29	107 099	0,00
500 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 5.450%, 15/03/53	524 355	0,01	100 000 EUR	McDonald's Corp, 1.500%, 28/11/29	101 020	0,00
500 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 5.700%, 15/09/53	543 955	0,01	30 000 USD	McDonald's Corp, 2.125%, 01/03/30	26 257	0,00
50 000 USD	Martin Marietta Materials Inc, 3.500%, 15/12/27	47 975	0,00	500 000 EUR	McDonald's Corp, 3.875%, 20/02/31	573 744	0,01
35 000 USD	Martin Marietta Materials Inc, 2.500%, 15/03/30	30 879	0,00	100 000 EUR	McDonald's Corp, 1.600%, 15/03/31	99 320	0,00
50 000 USD	Martin Marietta Materials Inc, 2.400%, 15/07/31	42 624	0,00	100 000 EUR	McDonald's Corp, 3.000%, 31/05/34	107 163	0,00
50 000 USD	Martin Marietta Materials Inc, 4.250%, 15/12/47	44 267	0,00	15 000 USD	McDonald's Corp, 6.300%, 15/10/37	17 041	0,00
335 000 USD	Martin Marietta Materials Inc, 3.200%, 15/07/51	249 428	0,00	215 000 USD	McDonald's Corp, 6.300%, 01/03/38	244 949	0,00
50 000 USD	Masco Corp, 2.000%, 01/10/30	41 193	0,00	500 000 GBP	McDonald's Corp, 3.750%, 31/05/38	567 260	0,01
200 000 USD	Masco Corp, 4.500%, 15/05/47	173 416	0,00	150 000 USD	McDonald's Corp, 4.875%, 09/12/45	147 547	0,00
225 000 USD	Mass General Brigham Inc, 3.192%, 01/07/49	166 034	0,00	110 000 USD	McDonald's Corp, 4.450%, 01/09/48	102 230	0,00
30 000 USD	Mass General Brigham Inc, 3.342%, 01/07/60	21 510	0,00	25 000 USD	McDonald's Corp, 3.625%, 01/09/49	20 154	0,00
60 000 USD	Massachusetts Institute of Technology, 3.959%, 01/07/38	54 555	0,00	1 000 000 USD	McDonald's Corp, 5.450%, 14/08/53	1 067 700	0,02
100 000 USD	Massachusetts Institute of Technology, 4.678%, 01/07/14	97 137	0,00	100 000 GBP	McDonald's Corp, 4.125%, 11/06/54	111 815	0,00
300 000 USD	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 3.729%, 15/10/70	206 433	0,00	120 000 USD	McKesson Corp, 0.900%, 03/12/25	111 340	0,00
200 000 USD	MassMutual Global Funding II, 3.400%, 08/03/26	194 766	0,00	100 000 EUR	McKesson Corp, 1.625%, 30/10/26	106 368	0,00
500 000 USD	MassMutual Global Funding II, 4.500%, 10/04/26	498 690	0,01	1 500 000 USD	McKesson Corp, 4.900%, 15/07/28	1 527 585	0,02
500 000 USD	MassMutual Global Funding II, 5.050%, 07/12/27	507 930	0,01	100 000 GBP	McKesson Corp, 3.125%, 17/02/29	120 740	0,00
500 000 USD	MassMutual Global Funding II, 5.050%, 14/06/28	507 285	0,01	300 000 USD	McLaren Health Care Corp, 4.386%, 15/05/48	260 271	0,00
500 000 USD	MasTec Inc, 4.500%, 15/08/28	470 265	0,01	200 000 USD	MDC Holdings Inc, 3.966%, 06/08/61	131 014	0,00
50 000 USD	Mastercard Inc, 2.950%, 01/06/29	47 022	0,00	30 000 USD	Mead Johnson Nutrition Co, 4.125%, 15/11/25	29 594	0,00
250 000 USD	Mastercard Inc, 1.900%, 15/03/31	213 912	0,00	72 000 USD	Medtronic Inc, 4.375%, 15/03/35	70 422	0,00
50 000 USD	Mastercard Inc, 3.650%, 01/06/49	42 457	0,00	134 000 USD	Medtronic Inc, 4.625%, 15/03/45	130 969	0,00
415 000 USD	Mastercard Inc, 2.950%, 15/03/51	309 412	0,01	110 000 USD	Memorial Sloan-Kettering Cancer Center, 2.955%, 01/01/50	77 650	0,00
600 000 USD	McCormick & Co Inc, 1.850%, 15/02/31	494 106	0,01	32 000 USD	Memorial Sloan-Kettering Cancer Center, 4.200%, 01/07/55	27 983	0,00
200 000 USD	McCormick & Co Inc, 4.200%, 15/08/47	172 718	0,00	500 000 USD	Mercedes-Benz Finance North America LLC, 1.450%, 02/03/26	466 345	0,01
30 000 USD	McDonald's Corp, 1.450%, 01/09/25	28 410	0,00				
60 000 USD	McDonald's Corp, 3.700%, 30/01/26	58 998	0,00				
200 000 USD	McDonald's Corp, 3.500%, 01/03/27	194 854	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
1 000 000 USD	Mercedes-Benz Finance North America LLC, 5.200%, 03/08/26	1 013 520	0,02	1 000 000 USD	Microsoft Corp, 3.700%, 08/08/46	879 060	0,01
1 000 000 USD	Mercedes-Benz Finance North America LLC, 5.050%, 03/08/33	1 029 580	0,02	2 000 000 USD	Microsoft Corp, 4.500%, 15/06/47	1 965 140	0,03
150 000 USD	Merck & Co Inc, 2.750%, 10/02/25	146 680	0,00	217 000 USD	Microsoft Corp, 2.525%, 01/06/50	148 652	0,00
100 000 EUR	Merck & Co Inc, 1.875%, 15/10/26	107 481	0,00	697 000 USD	Microsoft Corp, 2.921%, 17/03/52	514 323	0,01
600 000 USD	Merck & Co Inc, 1.700%, 10/06/27	550 962	0,01	644 000 USD	Microsoft Corp, 2.675%, 01/06/60	432 807	0,01
100 000 USD	Merck & Co Inc, 3.400%, 07/03/29	96 065	0,00	666 000 USD	Microsoft Corp, 3.041%, 17/03/62	483 070	0,01
595 000 USD	Merck & Co Inc, 2.150%, 10/12/31	508 636	0,01	50 000 USD	Mid-America Apartments LP, 4.000%, 15/11/25	49 135	0,00
100 000 USD	Merck & Co Inc, 3.900%, 07/03/39	91 103	0,00	100 000 USD	Mid-America Apartments LP, 3.950%, 15/03/29	97 373	0,00
500 000 USD	Merck & Co Inc, 2.350%, 24/06/40	364 170	0,01	375 000 USD	Mid-America Apartments LP, 1.700%, 15/02/31	305 452	0,01
100 000 USD	Merck & Co Inc, 3.600%, 15/09/42	85 051	0,00	100 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 0.625%, 13/06/25	105 845	0,00
195 000 USD	Merck & Co Inc, 3.700%, 10/02/45	166 234	0,00	100 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 1.250%, 13/06/28	102 035	0,00
200 000 USD	Merck & Co Inc, 4.000%, 07/03/49	177 302	0,00	100 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 1.750%, 13/06/31	99 966	0,00
600 000 USD	Merck & Co Inc, 2.750%, 10/12/51	414 138	0,01	200 000 USD	Mohawk Industries Inc, 3.625%, 15/05/30	185 234	0,00
555 000 USD	Merck & Co Inc, 2.900%, 10/12/61	372 322	0,01	100 000 USD	Molex Electronic Technologies LLC, 3.900%, 15/04/25	97 203	0,00
300 000 USD	Mercury General Corp, 4.400%, 15/03/27	287 304	0,01	45 000 USD	Molson Coors Beverage Co, 3.000%, 15/07/26	43 111	0,00
1 000 000 USD	Meta Platforms Inc, 5.750%, 15/05/63	1 098 100	0,02	40 000 USD	Molson Coors Beverage Co, 4.200%, 15/07/46	34 173	0,00
150 000 USD	MetLife Inc, 3.600%, 13/11/25	147 606	0,00	100 000 EUR	Mondelez International Inc, 0.250%, 17/03/28	98 775	0,00
1 000 000 USD	MetLife Inc, 5.375%, 15/07/33	1 043 950	0,02	35 000 USD	Mondelez International Inc, 1.875%, 15/10/32	28 572	0,00
200 000 USD	MetLife Inc, 5.700%, 15/06/35	215 332	0,00	100 000 EUR	Mondelez International Inc, 0.750%, 17/03/33	89 238	0,00
300 000 USD	MetLife Inc, 5.875%, 06/02/41	328 149	0,01	100 000 EUR	Mondelez International Inc, 1.375%, 17/03/41	80 943	0,00
400 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 1.750%, 25/05/25	431 361	0,01	300 000 USD	Montefiore Obligated Group, 4.287%, 01/09/50	185 205	0,00
100 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.550%, 16/06/27	101 418	0,00	100 000 EUR	Moody's Corp, 0.950%, 25/02/30	98 064	0,00
300 000 GBP	Metropolitan Life Global Funding I, 0.625%, 08/12/27	333 170	0,01	600 000 USD	Moody's Corp, 2.750%, 19/08/41	438 540	0,01
500 000 GBP	Metropolitan Life Global Funding I, 1.625%, 12/10/28	566 279	0,01	100 000 USD	Moody's Corp, 5.250%, 15/07/44	101 919	0,00
100 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.500%, 25/05/29	96 109	0,00	100 000 EUR	Morgan Stanley, 1.750%, 30/01/25	108 209	0,00
200 000 USD	Metropolitan Life Global Funding I, 3.050%, 17/06/29	182 472	0,00	200 000 USD	Morgan Stanley, 4.000%, 23/07/25	197 256	0,00
200 000 USD	Micron Technology Inc, 4.975%, 06/02/26	200 186	0,00	135 000 USD	Morgan Stanley, 3.875%, 27/01/26	132 282	0,00
500 000 USD	Micron Technology Inc, 5.375%, 15/04/28	509 275	0,01	500 000 USD	Morgan Stanley, 2.630%, 18/02/26	483 975	0,01
500 000 USD	Micron Technology Inc, 2.703%, 15/04/32	420 020	0,01	500 000 USD	Morgan Stanley, 2.188%, 28/04/26	480 335	0,01
500 000 USD	Micron Technology Inc, 3.366%, 01/11/41	376 100	0,01	100 000 EUR	Morgan Stanley, 2.103%, 08/05/26	107 955	0,00
500 000 USD	Micron Technology Inc, 3.477%, 01/11/51	365 980	0,01	200 000 USD	Morgan Stanley, 3.125%, 27/07/26	191 566	0,00
100 000 USD	Microsoft Corp, 2.700%, 12/02/25	97 854	0,00	120 000 USD	Morgan Stanley, 4.350%, 08/09/26	117 871	0,00
100 000 USD	Microsoft Corp, 3.125%, 03/11/25	97 709	0,00	100 000 USD	Morgan Stanley, 3.625%, 20/01/27	97 057	0,00
50 000 USD	Microsoft Corp, 2.400%, 08/08/26	47 727	0,00	100 000 GBP	Morgan Stanley, 2.625%, 09/03/27	120 488	0,00
650 000 USD	Microsoft Corp, 3.400%, 15/09/26	633 405	0,01	125 000 EUR	Morgan Stanley, 1.875%, 27/04/27	131 753	0,00
260 000 USD	Microsoft Corp, 3.300%, 06/02/27	253 503	0,00	695 000 USD	Morgan Stanley, 1.593%, 04/05/27	640 415	0,01
500 000 USD	Microsoft Corp, 3.400%, 15/06/27	486 125	0,01	500 000 USD	Morgan Stanley, 1.512%, 20/07/27	457 060	0,01
100 000 EUR	Microsoft Corp, 3.125%, 06/12/28	113 783	0,00	345 000 USD	Morgan Stanley, 2.475%, 21/01/28	320 550	0,01
500 000 USD	Microsoft Corp, 1.350%, 15/09/30	416 730	0,01	675 000 USD	Morgan Stanley, 4.210%, 20/04/28	660 170	0,01
286 000 USD	Microsoft Corp, 3.450%, 08/08/36	263 466	0,00	150 000 USD	Morgan Stanley, 3.591%, 22/07/28	143 160	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
300 000 EUR	Morgan Stanley, 4.813%, 25/10/28	346 818	0,01	100 000 EUR	National Grid North America Inc, 1.054%, 20/01/31	93 334	0,00
800 000 EUR	Morgan Stanley, 4.656%, 02/03/29	917 531	0,01	25 000 USD	National Health Investors Inc, 3.000%, 01/02/31	20 121	0,00
500 000 USD	Morgan Stanley, 5.164%, 20/04/29	502 885	0,01	300 000 USD	National Life Insurance Co, 5.250%, 19/07/68	266 058	0,00
100 000 EUR	Morgan Stanley, 0.495%, 26/10/29	95 367	0,00	1 000 000 USD	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp, 4.800%, 15/03/28	1 013 020	0,02
205 000 USD	Morgan Stanley, 2.699%, 22/01/31	179 748	0,00	115 000 USD	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp, 2.400%, 15/03/30	99 855	0,00
100 000 EUR	Morgan Stanley, 0.497%, 07/02/31	91 485	0,00	165 000 USD	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp, 8.000%, 01/03/32	197 815	0,00
500 000 USD	Morgan Stanley, 3.622%, 01/04/31	460 815	0,01	1 000 000 USD	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp, 5.800%, 15/01/33	1 062 130	0,02
65 000 USD	Morgan Stanley, 1.794%, 13/02/32	51 940	0,00	125 000 USD	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp, 4.300%, 15/03/49	109 475	0,00
35 000 USD	Morgan Stanley, 7.250%, 01/04/32	41 319	0,00	500 000 USD	National Securities Clearing Corp, 5.100%, 21/11/27	510 490	0,01
100 000 EUR	Morgan Stanley, 2.950%, 07/05/32	104 546	0,00	150 000 USD	Nationwide Mutual Insurance Co, 4.950%, 22/04/44	129 829	0,00
500 000 USD	Morgan Stanley, 2.239%, 21/07/32	408 125	0,01	50 000 USD	NBCUniversal Media LLC, 4.450%, 15/01/43	45 855	0,00
275 000 USD	Morgan Stanley, 2.943%, 21/01/33	234 113	0,00	300 000 USD	Nestle Holdings Inc, 1.000%, 15/09/27	267 450	0,00
100 000 EUR	Morgan Stanley, 1.102%, 29/04/33	89 672	0,00	800 000 USD	Nestle Holdings Inc, 2.500%, 14/09/41	595 792	0,01
400 000 GBP	Morgan Stanley, 5.789%, 18/11/33	543 830	0,01	500 000 USD	Nestle Holdings Inc, 2.625%, 14/09/51	344 415	0,01
300 000 EUR	Morgan Stanley, 5.148%, 25/01/34	363 978	0,01	250 000 USD	New York and Presbyterian Hospital, 2.256%, 01/08/40	172 317	0,00
1 000 000 USD	Morgan Stanley, 5.424%, 21/07/34	1 014 690	0,02	500 000 USD	New York Life Global Funding, 4.700%, 02/04/26	500 610	0,01
1 000 000 USD	Morgan Stanley, 6.627%, 01/11/34	1 109 410	0,02	1 000 000 USD	New York Life Global Funding, 3.250%, 07/04/27	959 210	0,02
1 160 000 USD	Morgan Stanley, 5.297%, 20/04/37	1 128 796	0,02	100 000 GBP	New York Life Global Funding, 1.500%, 15/07/27	116 300	0,00
1 000 000 USD	Morgan Stanley, 5.948%, 19/01/38	1 012 580	0,02	500 000 USD	New York Life Global Funding, 4.850%, 09/01/28	504 190	0,01
100 000 USD	Morgan Stanley, 3.971%, 22/07/38	87 842	0,00	200 000 GBP	New York Life Global Funding, 0.750%, 14/12/28	216 823	0,00
300 000 USD	Morgan Stanley, 4.457%, 22/04/39	277 509	0,00	55 000 USD	Newmont Corp, 2.800%, 01/10/29	50 313	0,00
115 000 USD	Morgan Stanley, 3.217%, 22/04/42	88 843	0,00	125 000 USD	Newmont Corp, 2.250%, 01/10/30	108 166	0,00
125 000 USD	Morgan Stanley, 4.300%, 27/01/45	113 263	0,00	160 000 USD	Newmont Corp, 6.250%, 01/10/39	177 790	0,00
415 000 USD	Morgan Stanley, 4.375%, 22/01/47	374 554	0,01	735 000 USD	NextEra Energy Capital Holdings Inc, 1.900%, 15/06/28	652 643	0,01
500 000 USD	Morgan Stanley, 5.597%, 24/03/51	541 215	0,01	395 000 USD	NextEra Energy Capital Holdings Inc, 2.250%, 01/06/30	338 333	0,01
500 000 USD	Morgan Stanley, 2.802%, 25/01/52	334 520	0,01	100 000 USD	NextEra Energy Capital Holdings Inc, 4.800%, 01/12/77	86 709	0,00
1 000 000 USD	Morgan Stanley Bank NA, 5.479%, 16/07/25	1 008 960	0,02	400 000 USD	NextEra Energy Capital Holdings Inc, 5.650%, 01/05/79	374 692	0,01
500 000 USD	Morgan Stanley Direct Lending Fund, 4.500%, perpetual	482 490	0,01	100 000 USD	Niagara Mohawk Power Corp, 4.119%, 28/11/42	82 652	0,00
100 000 USD	Mosaic Co, 5.625%, 15/11/43	99 004	0,00				
35 000 USD	Mount Sinai Hospital, 3.737%, 01/07/49	26 985	0,00				
165 000 USD	MPLX LP, 4.125%, 01/03/27	161 647	0,00				
300 000 USD	MPLX LP, 4.000%, 15/03/28	289 803	0,01				
2 000 000 USD	MPLX LP, 5.000%, 01/03/33	1 963 900	0,03				
300 000 USD	MPLX LP, 4.500%, 15/04/38	267 636	0,00				
65 000 USD	MPLX LP, 5.200%, 01/03/47	60 477	0,00				
500 000 USD	MPLX LP, 5.200%, 01/12/47	457 265	0,01				
1 000 000 USD	MPLX LP, 5.650%, 01/03/53	991 030	0,02				
500 000 USD	MultiCare Health System, 2.803%, 15/08/50	307 935	0,01				
100 000 EUR	Mylan Inc, 2.125%, 23/05/25	107 807	0,00				
100 000 EUR	Nasdaq Inc, 0.875%, 13/02/30	95 891	0,00				
200 000 USD	Nasdaq Inc, 1.650%, 15/01/31	162 584	0,00				
100 000 EUR	Nasdaq Inc, 0.900%, 30/07/33	87 556	0,00				
100 000 USD	Nasdaq Inc, 3.950%, perpetual	79 635	0,00				
50 000 USD	National Fuel Gas Co, 5.200%, 15/07/25	49 765	0,00				
50 000 USD	National Fuel Gas Co, 3.950%, 15/09/27	47 623	0,00				
365 000 USD	National Fuel Gas Co, 2.950%, 01/03/31	306 494	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
300 000 USD	NIKE Inc, 2.850%, 27/03/30	276 042	0,00	200 000 USD	NSTAR Electric Co, 3.200%, 15/05/27	193 194	0,00
500 000 USD	NIKE Inc, 3.250%, 27/03/40	420 840	0,01	250 000 USD	NSTAR Electric Co, 3.250%, 15/05/29	235 250	0,00
50 000 USD	NIKE Inc, 3.875%, 01/11/45	44 416	0,00	1 200 000 USD	NSTAR Electric Co, 4.550%, 01/06/52	1 098 804	0,02
50 000 USD	NNN REIT Inc, 2.500%, 15/04/30	43 041	0,00	500 000 USD	NSTAR Electric Co, 4.950%, 15/09/52	489 440	0,01
325 000 USD	NNN REIT Inc, 3.000%, 15/04/52	213 340	0,00	100 000 USD	Nucor Corp, 3.950%, 01/05/28	97 564	0,00
100 000 USD	Norfolk Southern Corp, 2.900%, 15/06/26	95 961	0,00	600 000 USD	Nucor Corp, 2.979%, perpetual	408 972	0,01
175 000 USD	Norfolk Southern Corp, 3.150%, 01/06/27	167 449	0,00	50 000 USD	NVIDIA Corp, 3.200%, 16/09/26	48 677	0,00
1 000 000 USD	Norfolk Southern Corp, 5.050%, 01/08/30	1 026 780	0,02	400 000 USD	NVIDIA Corp, 1.550%, 15/06/28	358 520	0,01
550 000 USD	Norfolk Southern Corp, 2.300%, 15/05/31	474 903	0,01	100 000 USD	NVIDIA Corp, 2.000%, 15/06/31	85 856	0,00
1 000 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.450%, 01/03/33	988 950	0,02	500 000 USD	NVIDIA Corp, 3.500%, 01/04/40	435 335	0,01
200 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.100%, 15/05/49	170 648	0,00	300 000 USD	NVIDIA Corp, 3.500%, 01/04/50	250 632	0,00
300 000 USD	Norfolk Southern Corp, 3.400%, 01/11/49	227 838	0,00	125 000 USD	NVR Inc, 3.000%, 15/05/30	111 506	0,00
200 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.050%, 15/08/52	168 958	0,00	125 000 USD	NYU Langone Hospitals, 4.368%, 01/07/47	111 951	0,00
1 000 000 USD	Norfolk Southern Corp, 5.350%, 01/08/54	1 042 280	0,02	300 000 USD	Oaktree Specialty Lending Corp, 3.500%, 25/02/25	289 869	0,01
525 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.100%, 15/05/21	398 932	0,01	2 000 000 USD	Oglethorpe Power Corp, 4.500%, 01/04/47	1 698 920	0,03
100 000 USD	Northern Trust Corp, 3.950%, 30/10/25	98 416	0,00	200 000 USD	Oglethorpe Power Corp, 5.050%, 01/10/48	185 076	0,00
300 000 USD	Northern Trust Corp, 3.650%, 03/08/28	291 066	0,01	55 000 USD	Old Republic International Corp, 3.850%, 11/06/51	40 557	0,00
200 000 USD	Northern Trust Corp, 3.150%, 03/05/29	188 768	0,00	100 000 USD	Omega Healthcare Investors Inc, 4.750%, 15/01/28	96 534	0,00
50 000 USD	Northwell Healthcare Inc, 4.260%, 01/11/47	42 423	0,00	100 000 USD	Omega Healthcare Investors Inc, 3.625%, 01/10/29	88 605	0,00
50 000 USD	Northwell Healthcare Inc, 3.809%, 01/11/49	38 107	0,00	50 000 USD	Omnicom Group Inc, 2.450%, 30/04/30	43 542	0,00
500 000 USD	Northwestern Mutual Global Funding, 4.700%, 06/04/26	498 375	0,01	570 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 0.550%, 01/10/25	530 545	0,01
500 000 USD	Northwestern Mutual Global Funding, 4.900%, 12/06/28	502 335	0,01	200 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 3.700%, 15/11/28	193 336	0,00
100 000 USD	Northwestern Mutual Life Insurance Co, 3.850%, 30/09/47	80 971	0,00	1 000 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 4.150%, 01/06/32	965 600	0,02
25 000 USD	Northwestern University, 3.662%, 01/12/57	20 308	0,00	1 000 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 4.550%, 15/09/32	992 110	0,02
200 000 USD	NOV Inc, 3.600%, 01/12/29	185 082	0,00	150 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 3.800%, 30/09/47	121 383	0,00
385 000 USD	Novant Health Inc, 3.168%, 01/11/51	270 328	0,00	500 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 4.950%, 15/09/52	495 915	0,01
400 000 USD	Novartis Capital Corp, 1.750%, 14/02/25	387 228	0,01	1 000 000 USD	ONE Gas Inc, 4.250%, 01/09/32	957 450	0,02
100 000 USD	Novartis Capital Corp, 2.000%, 14/02/27	93 738	0,00	90 000 USD	ONE Gas Inc, 4.500%, 01/11/48	79 753	0,00
100 000 USD	Novartis Capital Corp, 2.200%, 14/08/30	88 180	0,00	100 000 USD	ONEOK Inc, 2.200%, 15/09/25	95 105	0,00
150 000 USD	Novartis Capital Corp, 4.000%, 20/11/45	135 402	0,00	100 000 USD	ONEOK Inc, 3.100%, 15/03/30	89 925	0,00
65 000 USD	Novartis Capital Corp, 2.750%, 14/08/50	47 033	0,00	100 000 USD	ONEOK Inc, 6.350%, 15/01/31	106 903	0,00
				1 500 000 USD	ONEOK Inc, 6.100%, 15/11/32	1 594 815	0,02
				150 000 USD	ONEOK Inc, 4.950%, 13/07/47	134 854	0,00
				100 000 USD	ONEOK Inc, 4.500%, 15/03/50	83 836	0,00
				100 000 USD	ONEOK Partners LP, 4.900%, 15/03/25	99 485	0,00
				15 000 USD	ONEOK Partners LP, 6.650%, 01/10/36	16 365	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
25 000 USD	ONEOK Partners LP, 6.850%, 15/10/37	27 638	0,00	625 000 USD	Paramount Global, 4.200%, 19/05/32	559 344	0,01
150 000 USD	Oracle Corp, 2.950%, 15/05/25	145 693	0,00	75 000 USD	Paramount Global, 4.850%, 01/07/42	60 249	0,00
500 000 USD	Oracle Corp, 5.800%, 10/11/25	508 220	0,01	250 000 USD	Paramount Global, 4.950%, 19/05/50	203 332	0,00
615 000 USD	Oracle Corp, 1.650%, 25/03/26	573 703	0,01	100 000 USD	Parker-Hannifin Corp, 3.250%, 01/03/27	96 067	0,00
440 000 USD	Oracle Corp, 2.650%, 15/07/26	417 481	0,01	200 000 USD	Parker-Hannifin Corp, 3.250%, 14/06/29	188 442	0,00
200 000 USD	Oracle Corp, 3.250%, 15/11/27	190 118	0,00	105 000 USD	Parker-Hannifin Corp, 4.200%, 21/11/34	100 765	0,00
1 000 000 USD	Oracle Corp, 4.500%, 06/05/28	1 001 100	0,02	200 000 USD	PayPal Holdings Inc, 2.650%, 01/10/26	190 058	0,00
500 000 USD	Oracle Corp, 6.150%, 09/11/29	537 925	0,01	25 000 USD	PeaceHealth Obligated Group, 1.375%, 15/11/25	23 175	0,00
500 000 USD	Oracle Corp, 2.950%, 01/04/30	451 685	0,01	50 000 USD	PECO Energy Co, 3.150%, 15/10/25	48 723	0,00
620 000 USD	Oracle Corp, 2.875%, 25/03/31	549 661	0,01	100 000 USD	PECO Energy Co, 3.700%, 15/09/47	81 133	0,00
500 000 USD	Oracle Corp, 6.250%, 09/11/32	544 205	0,01	60 000 USD	PECO Energy Co, 3.900%, 01/03/48	50 966	0,00
100 000 USD	Oracle Corp, 4.300%, 08/07/34	93 418	0,00	90 000 USD	PECO Energy Co, 2.800%, 15/06/50	61 550	0,00
200 000 USD	Oracle Corp, 3.900%, 15/05/35	178 312	0,00	110 000 USD	PECO Energy Co, 3.050%, 15/03/51	78 217	0,00
300 000 USD	Oracle Corp, 3.800%, 15/11/37	255 798	0,00	500 000 USD	PECO Energy Co, 2.850%, 15/09/51	337 035	0,01
500 000 USD	Oracle Corp, 3.600%, 01/04/40	400 710	0,01	500 000 USD	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp, 1.700%, 15/06/26	459 735	0,01
100 000 USD	Oracle Corp, 5.375%, 15/07/40	98 560	0,00	200 000 USD	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp, 4.200%, 01/04/27	193 540	0,00
1 160 000 USD	Oracle Corp, 3.650%, 25/03/41	923 464	0,01	500 000 USD	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp, 4.400%, 01/07/27	487 655	0,01
25 000 USD	Oracle Corp, 4.000%, 15/07/46	20 109	0,00	500 000 USD	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp, 5.875%, 15/11/27	511 660	0,01
320 000 USD	Oracle Corp, 4.000%, 15/11/47	253 738	0,00	500 000 USD	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp, 5.550%, 01/05/28	508 325	0,01
300 000 USD	Oracle Corp, 3.600%, 01/04/50	222 396	0,00	100 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.750%, 18/03/27	103 722	0,00
660 000 USD	Oracle Corp, 3.950%, 25/03/51	519 941	0,01	300 000 USD	PepsiCo Inc, 2.250%, 19/03/25	291 549	0,01
1 000 000 USD	Oracle Corp, 6.900%, 09/11/52	1 174 420	0,02	100 000 USD	PepsiCo Inc, 2.375%, 06/10/26	95 077	0,00
1 000 000 USD	Oracle Corp, 5.550%, 06/02/53	1 001 300	0,02	500 000 USD	PepsiCo Inc, 5.125%, 10/11/26	510 810	0,01
100 000 USD	O'Reilly Automotive Inc, 3.600%, 01/09/27	96 521	0,00	300 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.500%, 06/05/28	301 566	0,01
100 000 USD	O'Reilly Automotive Inc, 3.900%, 01/06/29	96 654	0,00	100 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.875%, 18/07/28	101 619	0,00
90 000 USD	O'Reilly Automotive Inc, 1.750%, 15/03/31	73 566	0,00	50 000 USD	PepsiCo Inc, 2.625%, 29/07/29	46 150	0,00
500 000 USD	O'Reilly Automotive Inc, 4.700%, 15/06/32	495 505	0,01	395 000 USD	PepsiCo Inc, 1.625%, 01/05/30	336 749	0,01
25 000 USD	Orlando Health Obligated Group, 3.327%, 01/10/50	18 574	0,00	40 000 USD	PepsiCo Inc, 1.400%, 25/02/31	33 112	0,00
1 000 000 USD	Otis Worldwide Corp, 5.250%, 16/08/28	1 026 490	0,02	300 000 USD	PepsiCo Inc, 1.950%, 21/10/31	254 844	0,00
35 000 USD	Owens Corning, 3.950%, 15/08/29	33 411	0,00	100 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.400%, 09/10/32	89 263	0,00
200 000 USD	Owens Corning, 3.875%, 01/06/30	188 050	0,00	100 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.750%, 14/10/33	90 312	0,00
35 000 USD	PACCAR Financial Corp, 1.800%, 06/02/25	33 875	0,00	1 000 000 USD	PepsiCo Inc, 2.625%, 21/10/41	755 440	0,01
1 000 000 USD	PACCAR Financial Corp, 2.850%, perpetual	977 410	0,02	100 000 USD	PepsiCo Inc, 3.450%, 06/10/46	82 895	0,00
500 000 USD	Pacific Gas and Electric Co, 6.950%, 15/03/34	551 275	0,01	200 000 USD	PepsiCo Inc, 2.875%, 15/10/49	147 272	0,00
1 000 000 USD	Pacific Life Global Funding II, 5.500%, 28/08/26	1 019 600	0,02	100 000 EUR	PepsiCo Inc, 1.050%, 09/10/50	71 888	0,00
1 000 000 USD	Pacific Life Global Funding II, 5.500%, 18/07/28	1 025 360	0,02	500 000 USD	PepsiCo Inc, 2.750%, 21/10/51	356 430	0,01
500 000 USD	Pacific Life Global Funding II, 2.450%, 11/01/32	408 425	0,01	500 000 USD	PepsiCo Inc, 4.650%, 15/02/53	497 475	0,01
35 000 USD	Packaging Corp of America, 3.400%, 15/12/27	33 395	0,00				
30 000 USD	Paramount Global, 7.875%, 30/07/30	32 549	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
150 000 USD	Pfizer Inc, 3.000%, 15/12/26	144 550	0,00	25 000 USD	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6.650%, 15/01/37	26 818	0,00
100 000 USD	Pfizer Inc, 3.600%, 15/09/28	97 455	0,00	50 000 USD	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 4.700%, 15/06/44	41 961	0,00
200 000 USD	Pfizer Inc, 3.450%, 15/03/29	192 774	0,00	285 000 USD	PNC Bank NA, 2.700%, 22/10/29	250 780	0,00
50 000 USD	Pfizer Inc, 1.700%, 28/05/30	42 652	0,00	300 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 1.150%, 13/08/26	272 847	0,00
400 000 USD	Pfizer Inc, 4.000%, 15/12/36	378 128	0,01	250 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 3.150%, 19/05/27	237 210	0,00
100 000 GBP	Pfizer Inc, 6.500%, 03/06/38	152 930	0,00	500 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 5.582%, 12/06/29	510 495	0,01
50 000 USD	Pfizer Inc, 4.100%, 15/09/38	46 076	0,00	465 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 2.307%, 23/04/32	389 154	0,01
250 000 USD	Pfizer Inc, 3.900%, 15/03/39	222 032	0,00	1 000 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 5.068%, 24/01/34	979 860	0,02
400 000 GBP	Pfizer Inc, 2.735%, 15/06/43	384 821	0,01	1 000 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 5.939%, 18/08/34	1 041 500	0,02
100 000 USD	Pfizer Inc, 4.300%, 15/06/43	92 095	0,00	5 000 USD	Potomac Electric Power Co, 6.500%, 15/11/37	5 746	0,00
35 000 USD	Pfizer Inc, 4.200%, 15/09/48	31 724	0,00	200 000 EUR	PPG Industries Inc, 0.875%, 03/11/25	211 110	0,00
45 000 USD	Pfizer Inc, 2.700%, 28/05/50	31 364	0,00	500 000 USD	PPG Industries Inc, 1.200%, 15/03/26	462 410	0,01
50 000 USD	Philip Morris International Inc, 3.375%, 11/08/25	48 839	0,00	200 000 USD	Principal Financial Group Inc, 3.100%, 15/11/26	190 724	0,00
200 000 USD	Philip Morris International Inc, 0.875%, 01/05/26	183 272	0,00	200 000 USD	Principal Financial Group Inc, 2.125%, 15/06/30	169 140	0,00
100 000 USD	Philip Morris International Inc, 3.125%, 02/03/28	94 550	0,00	100 000 USD	Principal Financial Group Inc, 4.300%, 15/11/46	86 022	0,00
200 000 USD	Philip Morris International Inc, 1.750%, 01/11/30	164 948	0,00	800 000 USD	Principal Life Global Funding II, 0.875%, 12/01/26	734 560	0,01
400 000 EUR	Philip Morris International Inc, 0.800%, 01/08/31	360 328	0,00	300 000 USD	Principal Life Global Funding II, 1.250%, 16/08/26	272 187	0,00
100 000 EUR	Philip Morris International Inc, 2.000%, 09/05/36	86 590	0,00	500 000 USD	Procter & Gamble Co, 1.000%, 23/04/26	464 270	0,01
45 000 USD	Philip Morris International Inc, 6.375%, 16/05/38	50 383	0,00	200 000 USD	Procter & Gamble Co, 2.450%, 03/11/26	191 088	0,00
100 000 EUR	Philip Morris International Inc, 1.450%, 01/08/39	72 415	0,00	50 000 EUR	Procter & Gamble Co, 4.875%, 11/05/27	58 824	0,00
100 000 USD	Philip Morris International Inc, 3.875%, 21/08/42	82 225	0,00	50 000 USD	Procter & Gamble Co, 2.850%, 11/08/27	47 922	0,00
100 000 USD	Philip Morris International Inc, 4.875%, 15/11/43	94 768	0,00	100 000 EUR	Procter & Gamble Co, 1.200%, 30/10/28	103 142	0,00
300 000 USD	Phillips 66, 3.900%, 15/03/28	292 320	0,01	100 000 EUR	Procter & Gamble Co, 0.350%, 05/05/30	95 147	0,00
300 000 USD	Phillips 66, 2.150%, 15/12/30	253 425	0,00	750 000 USD	Procter & Gamble Co, 1.950%, 23/04/31	650 107	0,01
45 000 USD	Phillips 66, 4.875%, 15/11/44	43 235	0,00	500 000 EUR	Procter & Gamble Co, 3.250%, 02/08/31	569 745	0,01
500 000 USD	Phillips 66, 3.300%, 15/03/52	359 385	0,01	100 000 EUR	Procter & Gamble Co, 1.875%, 30/10/38	96 972	0,00
650 000 USD	Phillips 66 Co, 3.605%, 15/02/25	638 787	0,01	100 000 EUR	Procter & Gamble Co, 0.900%, 04/11/41	77 891	0,00
500 000 USD	Phillips 66 Co, 4.950%, 01/12/27	504 720	0,01	100 000 USD	Progressive Corp, 2.450%, 15/01/27	93 931	0,00
400 000 USD	Physicians Realty LP, 2.625%, 01/11/31	329 852	0,01				
100 000 USD	Piedmont Operating Partnership LP, 3.150%, 15/08/30	75 922	0,00				
200 000 USD	Pine Street Trust I, 4.572%, 15/02/29	190 958	0,00				
200 000 USD	Pine Street Trust II, 5.568%, 15/02/49	180 196	0,00				
100 000 USD	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 4.500%, 15/12/26	98 818	0,00				
200 000 USD	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 3.550%, 15/12/29	184 332	0,00				
500 000 USD	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 3.800%, 15/09/30	460 735	0,01				

Tableau des investissements (suite)
au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
150 000 USD	Progressive Corp, 4.350%, 25/04/44	133 729	0,00	1 000 000 USD	Public Service Enterprise Group Inc, 5.850%, 15/11/27	1 042 000	0,02
300 000 USD	Progressive Corp, 2.500%, perpetual	281 880	0,00	1 000 000 USD	Public Service Enterprise Group Inc, 5.875%, 15/10/28	1 050 570	0,02
100 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 0.250%, 10/09/27	99 406	0,00	200 000 USD	Public Storage Operating Co, 3.094%, 15/09/27	190 686	0,00
100 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.875%, 05/01/29	102 756	0,00	100 000 EUR	Public Storage Operating Co, 0.500%, 09/09/30	91 289	0,00
100 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 3.875%, 31/01/30	112 394	0,00	100 000 EUR	Public Storage Operating Co, 0.875%, 24/01/32	91 331	0,00
500 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 0.500%, 16/02/32	432 288	0,01	125 000 USD	Puget Energy Inc, 4.100%, 15/06/30	114 875	0,00
100 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 4.250%, 31/01/43	111 359	0,00	30 000 USD	Puget Sound Energy Inc, 4.223%, 15/06/48	25 598	0,00
100 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.500%, 10/09/49	67 405	0,00	2 100 000 USD	Puget Sound Energy Inc, 3.250%, 15/09/49	1 498 686	0,02
192 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 4.625%, perpetual	226 320	0,00	300 000 USD	Qualcomm Inc, 3.450%, 20/05/25	294 777	0,01
25 000 USD	Prologis LP, 2.125%, 15/04/27	23 141	0,00	150 000 USD	Qualcomm Inc, 3.250%, 20/05/27	145 273	0,00
65 000 USD	Prologis LP, 3.875%, 15/09/28	62 881	0,00	230 000 USD	Qualcomm Inc, 4.300%, 20/05/47	211 400	0,00
40 000 USD	Prologis LP, 2.875%, 15/11/29	36 362	0,00	1 000 000 USD	QUALCOMM Inc, 6.000%, 20/05/53	1 156 350	0,02
30 000 USD	Prologis LP, 2.250%, 15/04/30	26 295	0,00	500 000 USD	Quanta Services Inc, 3.050%, 01/10/41	367 445	0,01
145 000 USD	Prologis LP, 1.250%, 15/10/30	117 480	0,00	300 000 USD	Quest Diagnostics Inc, 2.950%, 30/06/30	269 058	0,00
70 000 USD	Prologis LP, 1.750%, 01/02/31	58 288	0,00	150 000 USD	Quest Diagnostics Inc, 4.700%, 30/03/45	136 714	0,00
100 000 USD	Prologis LP, 1.625%, 15/03/31	81 165	0,00	500 000 USD	Ralph Lauren Corp, 2.950%, 15/06/30	456 330	0,01
25 000 USD	Prologis LP, 3.000%, 15/04/50	18 019	0,00	165 000 USD	Raymond James Financial Inc, 3.750%, 01/04/51	125 228	0,00
105 000 USD	Prologis LP, 2.125%, 15/10/50	62 392	0,00	425 000 USD	Realty Income Corp, 4.875%, 01/06/26	425 391	0,01
500 000 USD	Prologis LP, 5.250%, 15/06/53	522 425	0,01	100 000 USD	Realty Income Corp, 3.000%, 15/01/27	94 966	0,00
500 000 USD	Protective Life Global Funding, 1.303%, 20/09/26	453 415	0,01	535 000 USD	Realty Income Corp, 2.200%, 15/06/28	480 323	0,01
80 000 USD	Providence St Joseph Health Obligated Group, 2.532%, 01/10/29	69 958	0,00	500 000 USD	Realty Income Corp, 4.700%, 15/12/28	503 475	0,01
105 000 USD	Prudential Financial Inc, 1.500%, 10/03/26	97 983	0,00	40 000 USD	Realty Income Corp, 3.250%, 15/01/31	36 424	0,00
100 000 USD	Prudential Financial Inc, 2.100%, 10/03/30	87 689	0,00	530 000 USD	Realty Income Corp, 2.850%, 15/12/32	451 995	0,01
150 000 USD	Prudential Financial Inc, 3.000%, 10/03/40	116 951	0,00	100 000 USD	Realty Income Corp, 1.800%, 15/03/33	77 850	0,00
50 000 USD	Prudential Financial Inc, 4.600%, 15/05/44	46 695	0,00	500 000 USD	Realty Income Corp, 4.900%, 15/07/33	501 265	0,01
200 000 USD	Prudential Financial Inc, 4.500%, 15/09/47	186 850	0,00	100 000 USD	Realty Income Corp, 4.650%, 15/03/47	93 582	0,00
300 000 USD	Prudential Financial Inc, 3.935%, 07/12/49	247 602	0,00	1 000 000 USD	Regal Rexnord Corp, 6.050%, 15/04/28	1 013 520	0,02
355 000 USD	Prudential Financial Inc, 3.700%, 01/10/50	307 512	0,01	140 000 USD	Regency Centers LP, 3.700%, 15/06/30	130 344	0,00
1 000 000 USD	Public Service Co of New Hampshire, 5.150%, 15/01/53	1 017 210	0,02	60 000 USD	Regency Centers LP, 4.650%, 15/03/49	51 517	0,00
545 000 USD	Public Service Electric and Gas Co, 1.900%, 15/08/31	447 701	0,01	100 000 USD	Regions Financial Corp, 2.250%, 18/05/25	95 314	0,00
1 000 000 USD	Public Service Electric and Gas Co, 4.900%, 15/12/32	1 017 230	0,02				
200 000 USD	Public Service Electric and Gas Co, 5.500%, 01/03/40	207 862	0,00				
200 000 USD	Public Service Electric and Gas Co, 3.850%, 01/05/49	167 326	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
150 000 USD	Regions Financial Corp, 1.800%, 12/08/28	128 631	0,00	500 000 USD	Ryder System Inc, 1.750%, 01/09/26	460 920	0,01
50 000 USD	Reinsurance Group of America Inc, 3.900%, 15/05/29	47 648	0,00	500 000 USD	Ryder System Inc, 5.650%, 01/03/28	515 465	0,01
70 000 USD	Reinsurance Group of America Inc, 3.150%, 15/06/30	62 945	0,00	1 000 000 USD	S&P Global Inc, 2.450%, 01/03/27	943 660	0,01
415 000 USD	Reliance Steel & Aluminum Co, 1.300%, 15/08/25	388 390	0,01	55 000 USD	S&P Global Inc, 2.500%, 01/12/29	49 646	0,00
365 000 USD	Reliance Steel & Aluminum Co, 2.150%, 15/08/30	309 819	0,01	25 000 USD	S&P Global Inc, 1.250%, 15/08/30	20 514	0,00
100 000 EUR	RELX Capital Inc, 1.300%, 12/05/25	107 332	0,00	500 000 USD	S&P Global Inc, 2.900%, 01/03/32	447 000	0,01
100 000 USD	RELX Capital Inc, 4.000%, 18/03/29	98 223	0,00	65 000 USD	S&P Global Inc, 3.250%, 01/12/49	48 992	0,00
25 000 USD	RELX Capital Inc, 3.000%, 22/05/30	22 967	0,00	300 000 USD	S&P Global Inc, 3.700%, 01/03/52	250 128	0,00
30 000 USD	RenaissanceRe Finance Inc, 3.450%, 01/07/27	28 322	0,00	30 000 USD	S&P Global Inc, 2.300%, 15/08/60	18 097	0,00
55 000 USD	Republic Services Inc, 2.900%, 01/07/26	52 874	0,00	145 000 USD	Sabine Pass Liquefaction LLC, 5.625%, 01/03/25	145 289	0,00
180 000 USD	Republic Services Inc, 3.375%, 15/11/27	173 124	0,00	100 000 USD	Sabine Pass Liquefaction LLC, 5.875%, 30/06/26	101 768	0,00
150 000 USD	Republic Services Inc, 2.300%, 01/03/30	132 366	0,00	200 000 USD	Sabine Pass Liquefaction LLC, 4.200%, 15/03/28	196 152	0,00
200 000 USD	Republic Services Inc, 1.450%, 15/02/31	162 690	0,00	645 000 USD	Sabine Pass Liquefaction LLC, 4.500%, 15/05/30	631 803	0,01
65 000 USD	Revvity Inc, 3.300%, 15/09/29	59 056	0,00	100 000 USD	Sabra Health Care LP, 3.900%, 15/10/29	90 670	0,00
200 000 USD	Reynolds American Inc, 5.850%, 15/08/45	188 626	0,00	580 000 USD	Salesforce Inc, 1.950%, 15/07/31	495 703	0,01
500 000 USD	RGA Global Funding, 6.000%, 21/11/28	519 105	0,01	500 000 USD	Salesforce Inc, 2.700%, 15/07/41	382 840	0,01
500 000 USD	Roche Holdings Inc, 0.991%, 05/03/26	463 490	0,01	500 000 USD	Sammons Financial Group Inc, 4.750%, 08/04/32	439 845	0,01
500 000 USD	Roche Holdings Inc, 5.265%, 13/11/26	511 135	0,01	50 000 USD	San Diego Gas & Electric Co, 4.500%, 15/08/40	46 113	0,00
500 000 USD	Roche Holdings Inc, 5.593%, 13/11/33	539 470	0,01	100 000 USD	San Diego Gas & Electric Co, 3.750%, 01/06/47	80 860	0,00
100 000 USD	Roche Holdings Inc, 4.000%, 28/11/44	90 285	0,00	100 000 USD	Santander Holdings USA Inc, 4.500%, 17/07/25	98 941	0,00
30 000 USD	Rockefeller Foundation, 2.492%, 01/10/50	19 957	0,00	500 000 USD	Santander Holdings USA Inc, 3.244%, 05/10/26	474 150	0,01
85 000 USD	Rockwell Automation Inc, 3.500%, 01/03/29	82 462	0,00	325 000 USD	Santander Holdings USA Inc, 4.400%, 13/07/27	315 962	0,01
500 000 USD	Rockwell Automation Inc, 2.800%, 15/08/61	325 185	0,01	500 000 USD	Santander Holdings USA Inc, 6.499%, 09/03/29	517 690	0,01
125 000 USD	Roper Technologies Inc, 4.200%, 15/09/28	123 002	0,00	250 000 USD	Schlumberger Holdings Corp, 3.900%, 17/05/28	243 000	0,00
415 000 USD	Roper Technologies Inc, 2.000%, 30/06/30	353 136	0,01	300 000 USD	Sempra, 3.800%, 01/02/38	257 400	0,00
150 000 USD	Ross Stores Inc, 0.875%, 15/04/26	137 493	0,00	25 000 USD	Sempra, 6.000%, 15/10/39	26 378	0,00
150 000 USD	Ross Stores Inc, 1.875%, 15/04/31	123 717	0,00	125 000 USD	ServiceNow Inc, 1.400%, 01/09/30	102 914	0,00
250 000 USD	RPM International Inc, 4.550%, 01/03/29	246 740	0,00	110 000 USD	Sherwin-Williams Co, 3.450%, 01/06/27	106 317	0,00
50 000 USD	RPM International Inc, 4.250%, 15/01/48	41 468	0,00	150 000 USD	Sherwin-Williams Co, 2.950%, 15/08/29	138 532	0,00
				129 000 USD	Sherwin-Williams Co, 4.500%, 01/06/47	118 287	0,00
				500 000 USD	Sherwin-Williams Co, 2.900%, 15/03/52	347 185	0,01
				150 000 USD	Simon Property Group LP, 3.300%, 15/01/26	145 492	0,00
				100 000 USD	Simon Property Group LP, 3.250%, 30/11/26	96 123	0,00
				100 000 USD	Simon Property Group LP, 3.375%, 15/06/27	95 942	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
300 000 USD	Simon Property Group LP, 2.450%, 13/09/29	267 369	0,00	50 000 USD	Stanley Black & Decker Inc, 2.750%, 15/11/50	30 937	0,00
500 000 USD	Simon Property Group LP, 2.650%, 15/07/30	443 420	0,01	300 000 USD	Stanley Black & Decker Inc, 4.000%, 15/03/60	250 914	0,00
100 000 USD	Simon Property Group LP, 4.250%, 30/11/46	84 448	0,00	50 000 USD	Starbucks Corp, 3.800%, 15/08/25	49 109	0,00
1 000 000 USD	Simon Property Group LP, 6.650%, 15/01/54	1 183 650	0,02	1 000 000 USD	Starbucks Corp, 4.750%, 15/02/26	1 004 230	0,02
87 000 USD	SITE Centers Corp, 3.625%, 01/02/25	84 626	0,00	50 000 USD	Starbucks Corp, 2.450%, 15/06/26	47 594	0,00
100 000 USD	Smithfield Foods Inc, 4.250%, 01/02/27	96 050	0,00	50 000 USD	Starbucks Corp, 4.000%, 15/11/28	49 294	0,00
60 000 USD	Southern California Edison Co, 3.700%, 01/08/25	58 798	0,00	200 000 USD	Starbucks Corp, 3.550%, 15/08/29	193 012	0,00
175 000 USD	Southern California Edison Co, 1.200%, 01/02/26	162 872	0,00	200 000 USD	Starbucks Corp, 2.550%, 15/11/30	177 072	0,00
115 000 USD	Southern California Edison Co, 2.850%, 01/08/29	105 046	0,00	35 000 USD	Starbucks Corp, 4.300%, 15/06/45	31 443	0,00
205 000 USD	Southern California Edison Co, 6.000%, 15/01/34	225 188	0,00	130 000 USD	Starbucks Corp, 4.500%, 15/11/48	119 072	0,00
50 000 USD	Southern California Edison Co, 4.500%, 01/09/40	44 934	0,00	300 000 USD	Steel Dynamics Inc, 2.400%, 15/06/25	287 352	0,01
200 000 USD	Southern California Edison Co, 3.900%, 15/03/43	164 312	0,00	100 000 USD	Stryker Corp, 3.375%, 01/11/25	97 356	0,00
250 000 USD	Southern California Edison Co, 4.000%, 01/04/47	205 677	0,00	200 000 USD	Stryker Corp, 3.650%, 07/03/28	193 754	0,00
200 000 USD	Southern California Edison Co, 3.650%, 01/02/50	155 374	0,00	100 000 EUR	Stryker Corp, 0.750%, 01/03/29	98 228	0,00
100 000 USD	Southern California Gas Co, 2.600%, 15/06/26	95 454	0,00	100 000 EUR	Stryker Corp, 2.625%, 30/11/30	106 921	0,00
250 000 USD	Southern California Gas Co, 2.550%, 01/02/30	220 110	0,00	55 000 USD	Sutter Health, 2.294%, 15/08/30	47 007	0,00
1 000 000 USD	Southern California Gas Co, 6.350%, 15/11/52	1 149 960	0,02	55 000 USD	Sutter Health, 3.361%, 15/08/50	40 893	0,00
125 000 USD	Southwest Airlines Co, 5.250%, 04/05/25	125 042	0,00	1 000 000 USD	Sutter Health, 5.547%, 15/08/53	1 073 240	0,02
100 000 USD	Southwest Airlines Co, 3.000%, 15/11/26	95 054	0,00	200 000 USD	Synchrony Financial, 3.950%, 01/12/27	187 648	0,00
500 000 USD	Southwest Airlines Co, 5.125%, 15/06/27	502 560	0,01	150 000 USD	Sysco Corp, 3.250%, 15/07/27	143 580	0,00
85 000 USD	Southwest Gas Corp, 3.800%, 29/09/46	63 820	0,00	15 000 USD	Sysco Corp, 5.375%, 21/09/35	15 463	0,00
500 000 USD	Spire Missouri Inc, 3.300%, 01/06/51	355 555	0,01	200 000 USD	Sysco Corp, 4.450%, 15/03/48	176 586	0,00
100 000 USD	Spirit Realty LP, 3.400%, 15/01/30	91 108	0,00	500 000 USD	Take-Two Interactive Software Inc, 4.950%, 28/03/28	504 415	0,01
500 000 USD	Sprint Capital Corp, 6.875%, 15/11/28	541 775	0,01	100 000 USD	Tanger Properties LP, 3.125%, 01/09/26	93 793	0,00
125 000 USD	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 4.738%, 20/03/25	123 821	0,00	500 000 USD	Tapestry Inc, 7.700%, 27/11/30	527 665	0,01
145 000 USD	Stanley Black & Decker Inc, 3.400%, 01/03/26	140 250	0,00	1 000 000 USD	Targa Resources Corp, 6.500%, 30/03/34	1 082 660	0,02
500 000 USD	Stanley Black & Decker Inc, 6.000%, 06/03/28	526 050	0,01	400 000 USD	Target Corp, 1.950%, 15/01/27	373 436	0,01
100 000 USD	Stanley Black & Decker Inc, 2.300%, 15/03/30	85 208	0,00	250 000 USD	Target Corp, 3.375%, 15/04/29	240 827	0,00
				310 000 USD	Target Corp, 2.950%, 15/01/52	222 416	0,00
				120 000 USD	TC PipeLines LP, 3.900%, 25/05/27	115 264	0,00
				200 000 USD	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6.850%, 16/12/39	231 516	0,00
				100 000 USD	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 4.270%, 15/05/47	87 786	0,00
				310 000 USD	Texas Health Resources, 2.328%, 15/11/50	188 071	0,00
				500 000 USD	Texas Instruments Inc, 1.125%, 15/09/26	459 635	0,01
				35 000 USD	Texas Instruments Inc, 2.900%, 03/11/27	33 439	0,00
				255 000 USD	Texas Instruments Inc, 3.875%, 15/03/39	236 385	0,00
				500 000 USD	Texas Instruments Inc, 2.700%, 15/09/51	342 020	0,01
				100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 3.200%, 21/01/26	110 705	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
1 000 000 USD	Thermo Fisher Scientific Inc, 4.953%, 10/08/26	1 013 720	0,02	1 000 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 5.400%, 20/11/26	1 024 270	0,02
300 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.750%, 15/04/27	319 624	0,01	300 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 3.050%, 22/03/27	287 676	0,01
500 000 USD	Thermo Fisher Scientific Inc, 4.800%, 21/11/27	509 770	0,01	100 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 0.125%, 05/11/27	99 124	0,00
400 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 3.650%, 21/11/34	459 923	0,01	500 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 5.450%, 10/11/27	518 855	0,01
600 000 USD	Thermo Fisher Scientific Inc, 2.800%, 15/10/41	456 462	0,01	600 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 1.900%, 06/04/28	545 082	0,01
500 000 USD	Thermo Fisher Scientific Inc, 5.404%, 10/08/43	529 520	0,01	400 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 4.050%, 13/09/29	463 577	0,01
300 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.875%, 01/10/49	236 918	0,00	200 000 USD	Trane Technologies Global Holding Co Ltd, 3.750%, 21/08/28	194 680	0,00
250 000 USD	Time Warner Cable Enterprises LLC, 8.375%, 15/07/33	289 360	0,01	180 000 USD	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7.850%, 01/02/26	188 746	0,00
100 000 USD	Time Warner Cable LLC, 6.750%, 15/06/39	99 765	0,00	75 000 USD	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3.250%, 15/05/30	68 151	0,00
100 000 USD	Time Warner Cable LLC, 5.500%, 01/09/41	87 694	0,00	300 000 USD	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4.600%, 15/03/48	271 635	0,00
100 000 GBP	Time Warner Cable LLC, 5.250%, 15/07/42	112 831	0,00	150 000 USD	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3.950%, 15/05/50	121 815	0,00
100 000 USD	TJX Cos Inc, 2.250%, 15/09/26	94 537	0,00	235 000 USD	Travelers Cos Inc, 6.250%, 15/06/37	267 211	0,00
1 000 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.750%, 15/04/27	970 340	0,02	300 000 USD	Travelers Cos Inc, 5.350%, 01/11/40	314 178	0,01
500 000 USD	T-Mobile USA Inc, 2.050%, 15/02/28	451 605	0,01	150 000 USD	Travelers Cos Inc, 4.000%, 30/05/47	129 549	0,00
500 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.875%, 15/04/30	474 385	0,01	25 000 USD	Travelers Property Casualty Corp, 6.375%, 15/03/33	28 647	0,00
50 000 USD	T-Mobile USA Inc, 2.250%, 15/11/31	41 647	0,00	525 000 USD	Trinity Health Corp, 2.632%, 01/12/40	381 853	0,01
500 000 USD	T-Mobile USA Inc, 5.050%, 15/07/33	504 910	0,01	200 000 USD	Truist Financial Corp, 3.700%, 05/06/25	195 614	0,00
1 000 000 USD	T-Mobile USA Inc, 4.375%, 15/04/40	906 080	0,01	500 000 USD	Truist Financial Corp, 1.125%, 03/08/27	438 920	0,01
520 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.000%, 15/02/41	390 234	0,01	500 000 USD	Truist Financial Corp, 4.873%, 26/01/29	494 290	0,01
500 000 USD	T-Mobile USA Inc, 4.500%, 15/04/50	443 260	0,01	100 000 USD	Truist Financial Corp, 3.875%, 19/03/29	93 727	0,00
550 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.300%, 15/02/51	399 388	0,01	1 000 000 USD	Truist Financial Corp, 5.122%, 26/01/34	968 080	0,02
500 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.400%, 15/10/52	365 780	0,01	500 000 USD	Truist Financial Corp, 1.887%, perpetual	432 705	0,01
520 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.600%, 15/11/60	378 565	0,01	80 000 USD	Trustees of Princeton University, 2.516%, 01/07/50	55 220	0,00
300 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 1.800%, 13/02/25	290 115	0,01	50 000 USD	Trustees of the University of Pennsylvania, 3.610%, 15/02/19	36 041	0,00
100 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 0.800%, 16/10/25	93 528	0,00	1 000 000 USD	TSMC Arizona Corp, 3.875%, 22/04/27	979 600	0,02
500 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 5.400%, 10/11/25	507 645	0,01	500 000 USD	TSMC Arizona Corp, 3.125%, 25/10/41	405 595	0,01
500 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 0.800%, 09/01/26	464 080	0,01	30 000 USD	TWDC Enterprises 18 Corp, 1.850%, 30/07/26	28 075	0,00
400 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 0.250%, 16/07/26	412 300	0,01	100 000 USD	TWDC Enterprises 18 Corp, 2.950%, 15/06/27	96 003	0,00
1 000 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 5.000%, 14/08/26	1 012 700	0,02	100 000 USD	TWDC Enterprises 18 Corp, 4.125%, 01/06/44	89 393	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
400 000 USD	Tyson Foods Inc, 4.000%, 01/03/26	392 528	0,01	229 679 USD	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 5.875%, 15/10/27	232 270	0,00
440 000 USD	Tyson Foods Inc, 3.550%, 02/06/27	420 240	0,01	36 480 USD	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4.875%, 15/01/26	35 425	0,00
38 000 USD	Tyson Foods Inc, 5.150%, 15/08/44	35 114	0,00	50 000 USD	United Parcel Service Inc, 3.050%, 15/11/27	47 910	0,00
135 000 USD	Tyson Foods Inc, 4.550%, 02/06/47	113 659	0,00	500 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.000%, 15/11/28	508 653	0,01
300 000 USD	UDR Inc, 1.900%, 15/03/33	230 088	0,00	100 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.500%, 15/11/32	96 993	0,00
200 000 USD	Unilever Capital Corp, 3.100%, 30/07/25	195 766	0,00	235 000 USD	United Parcel Service Inc, 6.200%, 15/01/38	269 724	0,00
300 000 USD	Unilever Capital Corp, 2.900%, 05/05/27	286 602	0,00	300 000 USD	United Parcel Service Inc, 5.200%, 01/04/40	312 567	0,01
100 000 USD	Unilever Capital Corp, 2.125%, 06/09/29	89 299	0,00	50 000 USD	United Parcel Service Inc, 3.750%, 15/11/47	42 486	0,00
15 000 USD	Unilever Capital Corp, 5.900%, 15/11/32	16 687	0,00	200 000 USD	United Parcel Service Inc, 4.250%, 15/03/49	182 496	0,00
150 000 USD	Union Pacific Corp, 3.250%, 15/01/25	146 934	0,00	500 000 USD	United Rentals North America Inc, 6.000%, 15/12/29	507 420	0,01
50 000 USD	Union Pacific Corp, 3.250%, 15/08/25	48 884	0,00	75 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.750%, 15/07/25	73 952	0,00
500 000 USD	Union Pacific Corp, 4.750%, 21/02/26	503 200	0,01	20 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.700%, 15/12/25	19 678	0,00
25 000 USD	Union Pacific Corp, 2.750%, 01/03/26	24 083	0,00	550 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 1.150%, 15/05/26	509 657	0,01
55 000 USD	Union Pacific Corp, 2.400%, 05/02/30	49 172	0,00	100 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 2.950%, 15/10/27	95 139	0,00
630 000 USD	Union Pacific Corp, 2.891%, 06/04/36	530 523	0,01	200 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.850%, 15/06/28	196 052	0,00
500 000 USD	Union Pacific Corp, 3.200%, 20/05/41	401 380	0,01	25 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.875%, 15/12/28	24 484	0,00
1 000 000 USD	Union Pacific Corp, 3.375%, 14/02/42	818 440	0,01	400 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 2.300%, 15/05/31	346 752	0,01
100 000 USD	Union Pacific Corp, 3.350%, 15/08/46	75 305	0,00	25 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 6.875%, 15/02/38	30 281	0,00
100 000 USD	Union Pacific Corp, 3.250%, 05/02/50	76 648	0,00	500 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 2.750%, 15/05/40	378 660	0,01
116 000 USD	Union Pacific Corp, 3.799%, 01/10/51	97 551	0,00	100 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.050%, 15/05/41	78 489	0,00
500 000 USD	Union Pacific Corp, 2.950%, 10/03/52	355 400	0,01	50 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.625%, 15/11/41	47 950	0,00
530 000 USD	Union Pacific Corp, 3.839%, 20/03/60	433 551	0,01	225 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.950%, 15/10/42	197 640	0,00
770 000 USD	Union Pacific Corp, 3.799%, 06/04/71	611 218	0,01	50 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.750%, 15/07/45	48 771	0,00
100 000 USD	Union Pacific Corp, 2.973%, perpetual	67 530	0,00	200 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.250%, 15/04/47	179 272	0,00
34 180 USD	United Airlines 2018-1 Class AA Pass Through Trust, 3.500%, 01/03/30	30 983	0,00	100 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.750%, 15/10/47	82 561	0,00
58 156 USD	United Airlines 2019-1 Class AA Pass Through Trust, 4.150%, 25/08/31	53 629	0,00	300 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.250%, 15/06/48	269 043	0,00
25 004 USD	United Airlines 2019-2 Class AA Pass Through Trust, 2.700%, 01/05/32	21 046	0,00	25 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.450%, 15/12/48	22 959	0,00
				500 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.700%, 15/08/49	406 975	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.250%, 15/05/51	75 740	0,00	250 000 USD	Verizon Communications Inc, 0.850%, 20/11/25	232 207	0,00
500 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.750%, 15/05/52	481 480	0,01	580 000 USD	Verizon Communications Inc, 1.450%, 20/03/26	540 183	0,01
1 000 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 5.050%, 15/04/53	1 012 480	0,02	35 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.625%, 15/08/26	33 358	0,00
250 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.875%, 15/08/59	204 665	0,00	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.375%, 27/10/26	105 686	0,00
500 000 USD	University of Miami, 4.063%, 01/04/52	427 640	0,01	100 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.125%, 16/03/27	98 640	0,00
50 000 USD	University of Notre Dame du Lac, 3.394%, 15/02/48	40 663	0,00	300 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.000%, 22/03/27	285 498	0,00
50 000 USD	University of Southern California, 3.028%, 01/10/39	41 284	0,00	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.875%, 08/04/27	103 249	0,00
100 000 USD	University of Southern California, 3.841%, 01/10/47	85 564	0,00	590 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.100%, 22/03/28	533 897	0,01
170 000 USD	Unum Group, 4.000%, 15/06/29	161 412	0,00	207 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.329%, 21/09/28	205 056	0,00
300 000 USD	Unum Group, 5.750%, 15/08/42	292 578	0,01	100 000 GBP	Verizon Communications Inc, 1.125%, 03/11/28	110 250	0,00
1 000 000 USD	UPMC, 5.377%, 15/05/43	1 016 950	0,02	85 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.875%, 08/02/29	82 499	0,00
500 000 USD	US Bancorp, 1.450%, 12/05/25	476 460	0,01	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.375%, 22/03/29	96 027	0,00
85 000 USD	US Bancorp, 3.100%, 27/04/26	81 520	0,00	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.875%, 26/10/29	103 061	0,00
200 000 USD	US Bancorp, 2.375%, 22/07/26	187 846	0,00	300 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.016%, 03/12/29	290 319	0,01
150 000 USD	US Bancorp, 3.150%, 27/04/27	142 786	0,00	300 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.150%, 22/03/30	274 707	0,00
100 000 USD	US Bancorp, 3.900%, 26/04/28	96 785	0,00	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.250%, 08/04/30	98 397	0,00
550 000 USD	US Bancorp, 1.375%, 22/07/30	444 207	0,01	180 000 USD	Verizon Communications Inc, 1.500%, 18/09/30	148 568	0,00
300 000 USD	US Bancorp, 2.491%, 03/11/36	235 143	0,00	500 000 USD	Verizon Communications Inc, 1.680%, 30/10/30	412 450	0,01
200 000 USD	Valero Energy Corp, 2.150%, 15/09/27	182 968	0,00	600 000 EUR	Verizon Communications Inc, 4.250%, 31/10/30	702 597	0,01
135 000 USD	Valero Energy Corp, 4.000%, 01/04/29	130 055	0,00	250 000 USD	Verizon Communications Inc, 1.750%, 20/01/31	205 520	0,00
35 000 USD	Valero Energy Corp, 7.500%, 15/04/32	40 475	0,00	665 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.550%, 21/03/31	573 935	0,01
35 000 USD	Valero Energy Corp, 6.625%, 15/06/37	38 475	0,00	100 000 GBP	Verizon Communications Inc, 2.500%, 08/04/31	111 137	0,00
110 000 USD	Valero Energy Corp, 4.000%, 01/06/52	85 274	0,00	500 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.750%, 22/03/32	452 945	0,01
100 000 USD	Ventas Realty LP, 3.500%, 01/02/25	97 756	0,00	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.300%, 18/05/33	92 208	0,00
50 000 USD	Ventas Realty LP, 4.000%, 01/03/28	47 773	0,00	300 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.500%, 10/08/33	292 980	0,01
100 000 USD	Ventas Realty LP, 4.400%, 15/01/29	97 327	0,00	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 4.750%, 31/10/34	122 364	0,00
50 000 USD	Ventas Realty LP, 3.000%, 15/01/30	44 218	0,00	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.125%, 19/09/35	85 361	0,00
595 000 USD	VeriSign Inc, 2.700%, 15/06/31	511 230	0,01	186 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.272%, 15/01/36	175 458	0,00
20 000 USD	Verisk Analytics Inc, 4.125%, 15/03/29	19 488	0,00	100 000 GBP	Verizon Communications Inc, 3.375%, 27/10/36	109 283	0,00
100 000 USD	Verisk Analytics Inc, 5.500%, 15/06/45	98 996	0,00				
300 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.376%, 15/02/25	294 483	0,01				
100 000 AUD	Verizon Communications Inc, 4.050%, 17/02/25	67 688	0,00				
100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.875%, 02/04/25	107 002	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 GBP	Verizon Communications Inc, 1.875%, 03/11/38	86 403	0,00	125 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 2.450%, 15/12/50	77 409	0,00
100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.500%, 19/09/39	82 720	0,00	1 000 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 5.450%, 01/04/53	1 034 230	0,02
100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.850%, 18/05/40	86 595	0,00	200 000 USD	Visa Inc, 3.150%, 14/12/25	195 256	0,00
250 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.650%, 20/11/40	180 592	0,00	235 000 USD	Visa Inc, 0.750%, 15/08/27	208 074	0,00
1 080 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.400%, 22/03/41	863 039	0,01	500 000 USD	Visa Inc, 1.100%, 15/02/31	406 145	0,01
500 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.850%, 03/09/41	370 725	0,01	230 000 USD	Visa Inc, 4.150%, 14/12/35	225 315	0,00
100 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.125%, 15/08/46	85 979	0,00	221 000 USD	Visa Inc, 4.300%, 14/12/45	206 562	0,00
400 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.000%, 22/03/50	331 624	0,01	250 000 USD	Visa Inc, 2.000%, 15/08/50	155 215	0,00
250 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.875%, 20/11/50	170 097	0,00	500 000 USD	VMware Inc, 1.400%, 15/08/26	457 250	0,01
555 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.550%, 22/03/51	427 888	0,01	130 000 USD	VMware Inc, 3.900%, 21/08/27	125 939	0,00
400 000 CAD	Verizon Communications Inc, 4.050%, 22/03/51	262 020	0,00	500 000 USD	Volkswagen Group of America Finance LLC, 4.350%, 08/06/27	490 230	0,01
664 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.987%, 30/10/56	441 314	0,01	250 000 USD	Volkswagen Group of America Finance LLC, 4.750%, 13/11/28	247 780	0,00
220 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.000%, 20/11/60	144 355	0,00	150 000 USD	Vulcan Materials Co, 3.500%, 01/06/30	139 722	0,00
545 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.700%, 22/03/61	416 642	0,01	60 000 USD	W R Berkley Corp, 4.000%, 12/05/50	48 130	0,00
300 000 USD	VF Corp, 2.800%, 23/04/27	275 463	0,00	50 000 USD	W R Berkley Corp, 3.550%, 30/03/52	36 101	0,00
100 000 EUR	VF Corp, 4.250%, 07/03/29	106 061	0,00	53 000 USD	Walgreens Boots Alliance Inc, 3.450%, 01/06/26	50 387	0,00
100 000 EUR	VF Corp, 0.625%, 25/02/32	77 423	0,00	300 000 USD	Walt Disney Co, 3.700%, 15/10/25	294 849	0,01
800 000 USD	Viatrix Inc, 1.650%, 22/06/25	757 584	0,01	70 000 USD	Walt Disney Co, 1.750%, 13/01/26	66 261	0,00
1 000 000 USD	Viatrix Inc, 2.700%, 22/06/30	847 260	0,01	300 000 CAD	Walt Disney Co, 3.057%, 30/03/27	219 797	0,00
600 000 USD	Viatrix Inc, 3.850%, 22/06/40	448 110	0,01	300 000 USD	Walt Disney Co, 2.000%, 01/09/29	266 466	0,00
500 000 USD	Viatrix Inc, 4.000%, 22/06/50	352 735	0,01	1 060 000 USD	Walt Disney Co, 2.650%, 13/01/31	943 771	0,01
200 000 USD	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4.125%, 15/08/30	183 424	0,00	100 000 USD	Walt Disney Co, 6.200%, 15/12/34	113 206	0,00
100 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 2.950%, 15/11/26	95 585	0,00	300 000 USD	Walt Disney Co, 4.625%, 23/03/40	293 106	0,01
50 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 3.800%, 01/04/28	48 534	0,00	500 000 USD	Walt Disney Co, 3.500%, 13/05/40	422 145	0,01
250 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 2.875%, 15/07/29	229 900	0,00	100 000 USD	Walt Disney Co, 4.750%, 15/11/46	96 173	0,00
800 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 2.300%, 15/11/31	674 472	0,01	200 000 USD	Walt Disney Co, 2.750%, 01/09/49	137 668	0,00
1 000 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 5.000%, 01/04/33	1 014 410	0,02	60 000 USD	Walt Disney Co, 3.800%, 13/05/60	48 926	0,00
15 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 6.000%, 15/01/36	16 119	0,00	1 000 000 USD	Warnermedia Holdings Inc, 3.638%, 15/03/25	978 910	0,02
50 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 4.450%, 15/02/44	44 797	0,00	1 300 000 USD	Warnermedia Holdings Inc, 3.755%, 15/03/27	1 246 726	0,02
100 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 3.800%, 15/09/47	80 248	0,00	1 000 000 USD	Warnermedia Holdings Inc, 5.050%, 15/03/42	882 810	0,01
90 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 4.600%, 01/12/48	81 509	0,00	100 000 USD	Washington Gas Light Co, 3.796%, 15/09/46	76 537	0,00
200 000 USD	Virginia Electric and Power Co, 3.300%, 01/12/49	146 782	0,00	500 000 USD	Washington University, 3.524%, 15/04/54	402 800	0,01
				20 000 USD	Waste Management Inc, 0.750%, 15/11/25	18 590	0,00
				30 000 USD	Waste Management Inc, 1.150%, 15/03/28	26 424	0,00
				550 000 USD	Waste Management Inc, 2.000%, 01/06/29	490 044	0,01
				500 000 USD	Waste Management Inc, 4.625%, 15/02/30	506 360	0,01
				30 000 USD	Waste Management Inc, 1.500%, 15/03/31	24 545	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)				Obligations d'entreprise – 23,11 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
535 000 USD	Waste Management Inc, 2.950%, 01/06/41	418 739	0,01	100 000 USD	Zoetis Inc, 4.700%, 01/02/43	95 746	0,00
20 000 USD	Waste Management Inc, 2.500%, 15/11/50	13 339	0,00	145 000 USD	Zoetis Inc, 3.000%, 15/05/50	105 672	0,00
50 000 USD	Welltower OP LLC, 4.000%, 01/06/25	49 111	0,00	États-Unis – Total			
50 000 USD	Welltower OP LLC, 4.250%, 01/04/26	49 265	0,00	681 945 638 10,22			
300 000 USD	Welltower OP LLC, 2.700%, 15/02/27	282 072	0,00	Total des obligations d'entreprise			
100 000 USD	Welltower OP LLC, 4.125%, 15/03/29	96 653	0,00	1 543 118 431 23,11			
55 000 USD	Welltower OP LLC, 3.100%, 15/01/30	49 704	0,00	Obligations d'État – 63,42 %			
300 000 USD	Welltower OP LLC, 2.750%, 15/01/32	255 585	0,00	Australie			
100 000 GBP	Welltower OP LLC, 4.500%, 01/12/34	120 796	0,00	2 850 000 AUD	Australia Government Bond, 3.250%, 21/04/25	1 929 723	0,03
150 000 USD	Welltower OP LLC, 6.500%, 15/03/41	165 783	0,00	6 300 000 AUD	Australia Government Bond, 0.250%, 21/11/25	4 030 859	0,06
50 000 USD	Western Union Co, 2.850%, 10/01/25	48 579	0,00	5 200 000 AUD	Australia Government Bond, 4.250%, 21/04/26	3 595 126	0,05
600 000 USD	Western Union Co, 1.350%, 15/03/26	550 422	0,01	10 100 000 AUD	Australia Government Bond, 0.500%, 21/09/26	6 342 393	0,10
600 000 USD	Western Union Co, 2.750%, 15/03/31	498 450	0,01	3 800 000 AUD	Australia Government Bond, 4.750%, 21/04/27	2 684 512	0,04
100 000 USD	Westinghouse Air Brake Technologies Corp, 3.450%, 15/11/26	95 691	0,00	4 200 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/11/27	2 777 228	0,05
100 000 EUR	Westlake Corp, 1.625%, 17/07/29	99 152	0,00	4 000 000 AUD	Australia Government Bond, 2.250%, 21/05/28	2 579 200	0,04
110 000 USD	Westlake Corp, 3.375%, 15/06/30	99 658	0,00	2 900 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/11/28	1 900 829	0,03
500 000 USD	Westlake Corp, 2.875%, 15/08/41	354 755	0,01	2 900 000 AUD	Australia Government Bond, 3.250%, 21/04/29	1 938 565	0,03
50 000 USD	Westlake Corp, 4.375%, 15/11/47	42 006	0,00	3 400 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/11/29	2 202 180	0,03
300 000 USD	Weyerhaeuser Co, 4.000%, 15/11/29	286 905	0,00	3 400 000 AUD	Australia Government Bond, 2.500%, 21/05/30	2 155 780	0,03
500 000 USD	Weyerhaeuser Co, 3.375%, 09/03/33	444 290	0,01	4 650 000 AUD	Australia Government Bond, 1.000%, 21/12/30	2 633 021	0,04
100 000 USD	Whirlpool Corp, 4.600%, 15/05/50	84 589	0,00	5 200 000 AUD	Australia Government Bond, 1.500%, 21/06/31	3 014 035	0,05
200 000 USD	Williams Cos Inc, 3.900%, 15/01/25	196 834	0,00	3 300 000 AUD	Australia Government Bond, 1.000%, 21/11/31	1 816 085	0,03
35 000 USD	Williams Cos Inc, 5.750%, 24/06/44	35 427	0,00	2 600 000 AUD	Australia Government Bond, 1.250%, 21/05/32	1 440 701	0,02
100 000 USD	Williams Cos Inc, 4.900%, 15/01/45	91 235	0,00	2 600 000 AUD	Australia Government Bond, 1.750%, 21/11/32	1 486 278	0,02
100 000 USD	WRKCo Inc, 3.900%, 01/06/28	95 511	0,00	900 000 AUD	Australia Government Bond, 4.500%, 21/04/33	640 595	0,01
100 000 USD	WRKCo Inc, 4.200%, 01/06/32	95 998	0,00	2 000 000 AUD	Australia Government Bond, 3.000%, 21/11/33	1 258 690	0,02
200 000 USD	WRKCo Inc, 3.000%, 15/06/33	172 688	0,00	2 500 000 AUD	Australia Government Bond, 3.750%, 21/05/34	1 674 486	0,03
300 000 USD	VW Grainger Inc, 1.850%, 15/02/25	289 656	0,01	4 000 000 AUD	Australia Government Bond, 3.500%, 21/12/34	2 612 526	0,04
350 000 USD	VW Grainger Inc, 4.600%, 15/06/45	338 390	0,01	1 450 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/06/35	875 794	0,01
15 000 USD	Wyeth LLC, 6.500%, 01/02/34	16 946	0,00	850 000 AUD	Australia Government Bond, 3.750%, 21/04/37	560 370	0,01
175 000 USD	Xylem Inc, 2.250%, 30/01/31	150 096	0,00	1 300 000 AUD	Australia Government Bond, 3.250%, 21/06/39	794 091	0,01
300 000 EUR	Zimmer Biomet Holdings Inc, 1.164%, 15/11/27	307 120	0,01	1 250 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/05/41	696 730	0,01
150 000 USD	Zoetis Inc, 3.000%, 12/09/27	142 500	0,00	960 000 AUD	Australia Government Bond, 3.000%, 21/03/47	528 918	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Australie (suite)				Australie (suite)			
2 200 000 AUD	Australia Government Bond, 1.750%, 21/06/51	886 261	0,01	800 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 6.500%, 14/03/33	632 729	0,01
3 000 000 AUD	Australia Government Bond, 4.750%, 21/06/54	2 205 798	0,03	500 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 2.000%, 22/08/33	275 424	0,01
900 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 1.250%, 20/03/25	593 929	0,01	400 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 2.250%, 16/04/40	189 336	0,00
400 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 4.000%, 20/05/26	273 595	0,00	250 000 AUD	South Australian Government Financing Authority, 3.000%, 24/05/28	164 279	0,00
600 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 3.000%, 20/05/27	398 159	0,01	1 200 000 AUD	South Australian Government Financing Authority, 1.750%, 24/05/32	667 183	0,01
250 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 3.000%, 15/11/28	163 494	0,00	500 000 AUD	South Australian Government Financing Authority, 1.750%, 24/05/34	260 054	0,00
400 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 3.000%, 20/04/29	259 749	0,00	500 000 AUD	South Australian Government Financing Authority, 2.000%, 23/05/36	251 067	0,00
900 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 1.250%, 20/11/30	506 903	0,01	300 000 AUD	Tasmanian Public Finance Corp, 3.250%, 24/01/28	199 323	0,00
300 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 2.000%, 20/03/31	175 948	0,00	400 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 0.500%, 20/11/25	255 652	0,00
200 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 1.500%, 20/02/32	109 635	0,00	300 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 5.500%, 17/11/26	213 184	0,00
1 700 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 2.500%, 22/11/32	996 215	0,02	1 000 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 1.250%, 19/11/27	615 937	0,01
500 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 2.000%, 08/03/33	277 024	0,01	300 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 3.000%, 20/10/28	195 499	0,00
1 300 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 1.750%, 20/03/34	681 072	0,01	800 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 2.500%, 22/10/29	499 071	0,01
1 000 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 4.750%, 20/02/35	685 919	0,01	1 400 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 1.500%, 20/11/30	795 986	0,01
2 300 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 4.250%, 20/02/36	1 494 026	0,02	800 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 1.500%, 10/09/31	441 644	0,01
1 500 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 2.250%, 20/11/40	698 197	0,01	300 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 4.250%, 20/12/32	200 083	0,00
800 000 AUD	New South Wales Treasury Corp, 2.250%, 07/05/41	369 522	0,01	1 700 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 2.250%, 15/09/33	942 194	0,01
500 000 AUD	Northern Territory Treasury Corp, 2.500%, 21/05/32	292 824	0,01	1 400 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 2.000%, 17/09/35	711 089	0,01
300 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 4.750%, 21/07/25	206 856	0,00	1 500 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 4.750%, 15/09/36	1 006 063	0,02
200 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 3.250%, 21/07/26	134 382	0,00	500 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 2.000%, 20/11/37	236 820	0,00
200 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 2.750%, 20/08/27	131 369	0,00	2 700 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 2.250%, 20/11/40	1 240 598	0,02
500 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 3.250%, 21/07/28	331 960	0,01	200 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 5.000%, 20/11/40	135 321	0,00
200 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 2.500%, 06/03/29	127 089	0,00	700 000 AUD	Treasury Corp of Victoria, 2.250%, 20/11/41	319 043	0,01
400 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 3.250%, 21/08/29	262 489	0,00	400 000 AUD	Western Australian Treasury Corp, 5.000%, 23/07/25	276 911	0,01
1 000 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 1.250%, 10/03/31	558 264	0,01	300 000 AUD	Western Australian Treasury Corp, 3.000%, 21/10/26	199 999	0,00
800 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 1.750%, 21/08/31	457 611	0,01	200 000 AUD	Western Australian Treasury Corp, 3.250%, 20/07/28	132 848	0,00
1 200 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 1.500%, 02/03/32	661 991	0,01	550 000 AUD	Western Australian Treasury Corp, 2.750%, 24/07/29	352 178	0,01
1 000 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 1.500%, 20/08/32	542 755	0,01				
2 300 000 AUD	Queensland Treasury Corp, 4.500%, 09/03/33	1 582 588	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)				
Australie (suite)				Autriche (suite)				
1 100 000 AUD	Western Australian Treasury Corp, 1.500%, 22/10/30	633 546	0,01	800 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.500%, 20/02/47	679 775	0,01	
400 000 AUD	Western Australian Treasury Corp, 1.750%, 22/10/31	228 022	0,00	200 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.850%, 23/05/49	180 807	0,00	
Australie – Total		80 505 422	1,21	650 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/03/51	437 699	0,01	
Autriche				1 000 000 EUR Republic of Austria Government Bond, 3.150%, 20/10/53				
75 000 EUR	Autobahnen- und Schnellstrassen-Finanzierungs AG, 3.375%, 22/09/25	83 585	0,00	245 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.800%, 26/01/62	325 027	0,01	
400 000 EUR	Autobahnen- und Schnellstrassen-Finanzierungs AG, 0.010%, 16/07/27	405 530	0,01	300 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.700%, 20/04/71	158 473	0,00	
200 000 EUR	Autobahnen- und Schnellstrassen-Finanzierungs AG, 0.100%, 09/07/29	194 008	0,00	430 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.500%, 02/11/86	300 922	0,00	
800 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/04/25	853 311	0,01	445 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.100%, 20/09/17	387 126	0,01	
1 700 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.200%, 20/10/25	1 837 530	0,03	450 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.850%, 30/06/20	235 801	0,00	
1 350 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 4.850%, 15/03/26	1 567 914	0,02	Autriche – Total			29 069 352	0,44
1 400 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.000%, 15/07/26	1 533 860	0,02	Belgique				
1 400 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/10/26	1 480 768	0,02	1 700 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/25	1 827 784	0,03	
1 075 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.500%, 20/04/27	1 121 058	0,02	940 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.500%, 28/03/26	1 085 482	0,02	
800 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 6.250%, 15/07/27	1 001 016	0,02	1 600 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.000%, 22/06/26	1 711 200	0,03	
950 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/02/28	986 285	0,01	1 900 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/27	1 999 245	0,03	
1 100 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/10/28	1 088 938	0,02	2 400 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.010%, 22/10/27	2 439 253	0,04	
1 050 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.500%, 20/02/29	1 059 344	0,02	1 770 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 5.500%, 28/03/28	2 211 464	0,03	
500 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.900%, 23/05/29	569 392	0,01	3 700 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/28	3 844 385	0,06	
1 200 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/02/30	1 147 754	0,02	1 600 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.900%, 22/06/29	1 643 507	0,02	
1 000 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.450%, 20/10/30	1 173 382	0,02	1 050 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.100%, 22/06/30	1 005 862	0,01	
1 650 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/02/31	1 533 360	0,02	800 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.000%, 22/06/31	798 344	0,01	
1 700 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.900%, 20/02/32	1 652 744	0,02	1 300 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.010%, 22/10/31	1 187 825	0,02	
1 300 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.900%, 20/02/33	1 473 066	0,02	1 100 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.000%, 28/03/32	1 350 989	0,02	
670 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.400%, 23/05/34	725 424	0,01	2 800 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.350%, 22/06/32	2 585 641	0,04	
1 100 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.250%, 20/10/36	892 211	0,01	1 100 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.250%, 22/04/33	1 087 735	0,02	
891 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 4.150%, 15/03/37	1 130 039	0,02	1 200 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.000%, 22/06/33	1 368 834	0,02	
1 600 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/10/40	1 107 867	0,02	735 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.000%, 22/06/34	835 829	0,01	
510 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.150%, 20/06/44	588 712	0,01	1 144 330 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 5.000%, 28/03/35	1 538 833	0,02	
				1 150 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.450%, 22/06/37	1 072 897	0,02	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Belgique (suite)				Canada			
550 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.900%, 22/06/38	536 273	0,01	400 000 USD	Canada Government International Bond, 1.625%, 22/01/25	387 600	0,01
1 200 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 2.750%, 22/04/39	1 294 866	0,02	1 000 000 USD	Canada Government International Bond, 2.875%, 28/04/25	977 910	0,01
1 400 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.400%, 22/06/40	1 031 553	0,01	500 000 USD	Canada Government International Bond, 0.750%, 19/05/26	461 375	0,01
1 435 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.250%, 28/03/41	1 853 495	0,03	2 000 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 0.950%, 15/06/25	1 448 096	0,02
1 000 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.450%, 22/06/43	1 165 804	0,02	500 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.950%, 15/12/25	365 005	0,01
930 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.750%, 22/06/45	1 136 550	0,02	400 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 2.250%, 15/12/25	293 696	0,00
900 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.600%, 22/06/47	748 582	0,01	1 000 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.250%, 15/06/26	714 007	0,01
1 200 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.700%, 22/06/50	988 538	0,01	400 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.900%, 15/09/26	289 462	0,00
1 300 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.400%, 22/06/53	963 400	0,01	700 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.100%, 15/12/26	493 610	0,01
800 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.300%, 22/06/54	902 066	0,01	1 000 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.550%, 15/12/26	714 606	0,01
900 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 2.250%, 22/06/57	816 723	0,01	500 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 2.350%, 15/06/27	364 633	0,01
770 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 2.150%, 22/06/66	675 250	0,01	1 000 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 3.600%, 15/12/27	762 164	0,01
900 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.650%, 22/06/71	448 189	0,01	100 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 2.350%, 15/03/28	72 647	0,00
500 000 EUR	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap, 0.375%, 15/04/30	479 832	0,01	800 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 2.650%, 15/03/28	588 224	0,01
500 000 EUR	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap, 0.300%, 20/10/31	457 673	0,01	1 500 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 3.100%, 15/06/28	1 122 736	0,02
700 000 EUR	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap, 3.250%, 05/04/33	794 512	0,01	1 500 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 3.950%, 15/06/28	1 162 164	0,02
300 000 EUR	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap, 1.500%, 12/07/38	267 396	0,00	500 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 2.650%, 15/12/28	366 506	0,01
100 000 EUR	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap, 0.875%, 21/03/46	68 408	0,00	700 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 2.100%, 15/09/29	495 829	0,01
300 000 EUR	Region Wallonne Belgium, 0.500%, 08/04/30	288 599	0,00	200 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.750%, 15/06/30	137 379	0,00
700 000 EUR	Region Wallonne Belgium, 3.250%, 22/06/33	787 243	0,01	1 000 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.100%, 15/03/31	647 020	0,01
500 000 EUR	Region Wallonne Belgium, 0.500%, 22/06/37	388 925	0,01	1 100 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.400%, 15/03/31	727 563	0,01
Belgique – Total		45 688 986	0,68	800 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.900%, 15/03/31	548 436	0,01
Bulgarie				300 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 1.600%, 15/12/31	198 649	0,00
100 000 EUR	Bulgaria Government International Bond, 3.000%, 21/03/28	109 269	0,00	500 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 2.150%, 15/12/31	345 480	0,01
500 000 EUR	Bulgaria Government International Bond, 4.125%, 23/09/29	568 354	0,01	300 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 2.450%, 15/12/31	211 998	0,00
300 000 EUR	Bulgaria Government International Bond, 0.375%, 23/09/30	268 108	0,00	700 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 3.550%, 15/09/32	534 524	0,01
500 000 EUR	Bulgaria Government International Bond, 4.875%, 13/05/36	592 534	0,01	400 000 CAD	Canada Housing Trust No 1, 3.650%, 15/06/33	307 411	0,00
Bulgarie – Total		1 538 265	0,02	200 000 CAD	Canada Post Corp, 4.360%, 16/07/40	159 383	0,00
				1 500 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.750%, 01/02/25	1 129 334	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Canada (suite)				Canada (suite)			
1 700 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.250%, 01/03/25	1 245 154	0,02	774 000 CAD	Canadian Government Bond, 5.750%, 01/06/33	711 615	0,01
2 500 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/04/25	1 832 360	0,03	2 300 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.250%, 01/12/33	1 768 834	0,03
450 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.250%, 01/06/25	332 787	0,01	661 000 CAD	Canadian Government Bond, 5.000%, 01/06/37	604 615	0,01
200 000 CAD	Canadian Government Bond, 9.000%, 01/06/25	161 750	0,00	4 900 000 CAD	Canadian Government Bond, 4.000%, 01/06/41	4 171 094	0,06
3 900 000 CAD	Canadian Government Bond, 0.500%, 01/09/25	2 796 607	0,04	4 575 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.500%, 01/12/45	3 713 223	0,06
1 800 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.000%, 01/10/25	1 344 021	0,02	2 905 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/12/48	2 097 764	0,03
3 100 000 CAD	Canadian Government Bond, 0.250%, 01/03/26	2 187 585	0,03	5 400 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.000%, 01/12/51	3 308 350	0,05
2 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.000%, 01/04/26	1 495 040	0,02	2 800 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.750%, 01/12/53	1 601 644	0,02
1 300 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/06/26	939 498	0,01	700 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/12/55	502 258	0,01
2 200 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.000%, 01/09/26	1 564 643	0,02	1 330 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/12/64	960 967	0,01
2 300 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.250%, 01/03/27	1 633 792	0,02	300 000 USD	CDP Financial Inc, 0.875%, 10/06/25	283 998	0,00
850 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.000%, 01/06/27	598 300	0,01	1 000 000 USD	CDP Financial Inc, 4.250%, 25/07/28	999 530	0,02
257 000 CAD	Canadian Government Bond, 8.000%, 01/06/27	224 435	0,00	200 000 CAD	City of Montreal Canada, 3.000%, 01/09/25	148 738	0,00
1 500 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.245%, 24/08/27	1 135 033	0,02	500 000 CAD	City of Montreal Canada, 2.000%, 01/09/31	333 938	0,01
1 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/09/27	743 978	0,01	300 000 CAD	City of Montreal Canada, 3.500%, 01/12/38	210 232	0,00
3 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.500%, 01/03/28	2 299 689	0,03	400 000 CAD	City of Ottawa Ontario, 2.500%, 11/05/51	220 983	0,00
1 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.000%, 01/06/28	723 669	0,01	800 000 CAD	City of Toronto Canada, 2.200%, 21/12/31	544 074	0,01
6 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.250%, 01/09/28	4 567 572	0,07	300 000 CAD	City of Toronto Canada, 2.800%, 22/11/49	175 659	0,00
3 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 4.000%, 01/03/29	2 368 853	0,04	500 000 GBP	CPPIB Capital Inc, 4.375%, 02/03/26	637 189	0,01
1 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.250%, 01/06/29	728 257	0,01	500 000 USD	CPPIB Capital Inc, 0.875%, 09/09/26	457 195	0,01
705 000 CAD	Canadian Government Bond, 5.750%, 01/06/29	605 110	0,01	250 000 GBP	CPPIB Capital Inc, 1.250%, 07/12/27	287 216	0,00
2 500 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.250%, 01/12/29	1 816 207	0,03	1 000 000 USD	CPPIB Capital Inc, 4.250%, 20/07/28	1 003 250	0,02
2 500 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.250%, 01/06/30	1 695 416	0,03	500 000 CAD	CPPIB Capital Inc, 1.950%, 30/09/29	348 112	0,01
3 100 000 CAD	Canadian Government Bond, 0.500%, 01/12/30	1 976 797	0,03	500 000 USD	CPPIB Capital Inc, 1.250%, 28/01/31	408 740	0,01
4 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/06/31	2 713 666	0,04	250 000 EUR	CPPIB Capital Inc, 1.500%, 04/03/33	245 210	0,00
2 500 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/12/31	1 684 514	0,03	700 000 CAD	CPPIB Capital Inc, 4.750%, 02/06/33	571 095	0,01
2 700 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.000%, 01/06/32	1 882 403	0,03	500 000 EUR	CPPIB Capital Inc, 0.750%, 02/02/37	415 150	0,01
2 500 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.500%, 01/12/32	1 809 324	0,03	500 000 EUR	CPPIB Capital Inc, 0.250%, 18/01/41	343 099	0,01
2 300 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/06/33	1 697 022	0,03	1 000 000 USD	Export Development Canada, 3.000%, 25/05/27	965 780	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Canada (suite)				Canada (suite)			
500 000 EUR	Export Development Canada, 2.875%, 19/01/28	560 726	0,01	500 000 CAD	Province of Alberta Canada, 2.050%, 01/06/30	346 648	0,01
1 000 000 CAD	Hydro-Quebec, 2.000%, 01/09/28	708 994	0,01	200 000 USD	Province of Alberta Canada, 1.300%, 22/07/30	166 908	0,00
200 000 CAD	Hydro-Quebec, 6.000%, 15/08/31	175 210	0,00	900 000 CAD	Province of Alberta Canada, 1.650%, 01/06/31	595 095	0,01
300 000 CAD	Hydro-Quebec, 5.000%, 15/02/45	258 818	0,00	900 000 CAD	Province of Alberta Canada, 4.150%, 01/06/33	703 148	0,01
400 000 CAD	Hydro-Quebec, 5.000%, 15/02/50	355 456	0,01	400 000 CAD	Province of Alberta Canada, 3.450%, 01/12/43	277 831	0,00
600 000 CAD	Hydro-Quebec, 4.000%, 15/02/55	462 272	0,01	200 000 CAD	Province of Alberta Canada, 3.300%, 01/12/46	134 462	0,00
1 200 000 CAD	Hydro-Quebec, 2.100%, 15/02/60	602 748	0,01	550 000 CAD	Province of Alberta Canada, 3.050%, 01/12/48	352 003	0,01
1 300 000 CAD	Hydro-Quebec, 4.000%, 15/02/63	1 014 584	0,02	700 000 CAD	Province of Alberta Canada, 3.100%, 01/06/50	453 009	0,01
300 000 CAD	Labrador-Island Link Funding Trust, 3.760%, 01/06/33	228 486	0,00	400 000 CAD	Province of Alberta Canada, 2.950%, 01/06/52	251 294	0,00
100 000 CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia, 2.500%, 19/04/26	73 470	0,00	800 000 CAD	Province of Alberta Canada, 4.450%, 01/12/54	660 683	0,01
400 000 CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia, 1.350%, 30/06/26	285 260	0,00	200 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 2.850%, 18/06/25	148 679	0,00
300 000 CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia, 3.050%, 23/10/28	222 506	0,00	500 000 USD	Province of British Columbia Canada, 0.900%, 20/07/26	459 575	0,01
500 000 USD	OMERS Finance Trust, 1.100%, 26/03/26	463 335	0,01	400 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 2.550%, 18/06/27	293 044	0,00
200 000 CAD	Ontario Electricity Financial Corp, 8.250%, 22/06/26	166 903	0,00	1 000 000 USD	Province of British Columbia Canada, 4.800%, 15/11/28	1 030 800	0,02
500 000 USD	Ontario Teachers' Finance Trust, 1.375%, 15/04/25	478 285	0,01	700 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 2.950%, 18/12/28	517 642	0,01
1 000 000 USD	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.875%, 21/09/26	911 920	0,01	500 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 2.200%, 18/06/30	349 697	0,01
1 000 000 USD	Ontario Teachers' Finance Trust, 4.250%, 25/04/28	997 280	0,02	500 000 USD	Province of British Columbia Canada, 1.300%, 29/01/31	414 125	0,01
500 000 EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.100%, 19/05/28	491 205	0,01	700 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 1.550%, 18/06/31	459 311	0,01
300 000 USD	Ontario Teachers' Finance Trust, 1.250%, 27/09/30	244 521	0,00	400 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 5.000%, 18/06/31	330 226	0,01
500 000 USD	Ontario Teachers' Finance Trust, 2.000%, 16/04/31	423 795	0,01	700 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 3.200%, 18/06/32	511 739	0,01
300 000 EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.900%, 20/05/41	228 752	0,00	1 000 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 3.550%, 18/06/33	745 692	0,01
1 000 000 USD	Ontario Teachers' Finance Trust, 3.000%, perpetual	958 910	0,01	1 000 000 USD	Province of British Columbia Canada, 4.200%, 06/07/33	991 830	0,02
500 000 EUR	Province of Alberta Canada, 0.500%, 16/04/25	534 557	0,01	250 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 3.200%, 18/06/44	167 839	0,00
200 000 EUR	Province of Alberta Canada, 0.625%, 16/01/26	211 715	0,00	500 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 2.800%, 18/06/48	308 729	0,00
200 000 CAD	Province of Alberta Canada, 2.200%, 01/06/26	145 931	0,00	600 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 2.950%, 18/06/50	379 839	0,01
200 000 USD	Province of Alberta Canada, 2.050%, 17/08/26	188 732	0,00	600 000 CAD	Province of British Columbia Canada, 2.750%, 18/06/52	364 896	0,01
200 000 CAD	Province of Alberta Canada, 2.550%, 01/06/27	146 484	0,00	200 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 4.400%, 05/09/25	152 277	0,00
500 000 USD	Province of Alberta Canada, 3.300%, 15/03/28	483 130	0,01	400 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 2.600%, 02/06/27	293 366	0,00
500 000 CAD	Province of Alberta Canada, 2.900%, 01/12/28	368 777	0,01	500 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 3.000%, 02/06/28	370 920	0,01
200 000 CAD	Province of Alberta Canada, 2.900%, 20/09/29	146 872	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Canada (suite)				Canada (suite)			
1 500 000 USD	Province of Manitoba Canada, 1.500%, 25/10/28	1 329 285	0,02	200 000 CAD	Province of Nova Scotia Canada, 3.150%, 01/12/51	129 298	0,00
600 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 2.050%, 02/06/31	407 459	0,01	300 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.650%, 05/02/25	223 093	0,00
250 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 3.900%, 02/12/32	191 698	0,00	100 000 EUR	Province of Ontario Canada, 0.625%, 17/04/25	106 962	0,00
200 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 4.600%, 05/03/38	160 548	0,00	700 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.600%, 02/06/25	518 810	0,01
200 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 3.350%, 05/03/43	135 369	0,00	1 200 000 CAD	Province of Ontario Canada, 1.750%, 08/09/25	875 465	0,01
200 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 4.050%, 05/09/45	148 897	0,00	700 000 USD	Province of Ontario Canada, 1.050%, 14/04/26	650 349	0,01
400 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 3.400%, 05/09/48	268 391	0,00	200 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.400%, 02/06/26	146 657	0,00
200 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 3.200%, 05/03/50	129 289	0,00	1 300 000 CAD	Province of Ontario Canada, 1.350%, 08/09/26	926 543	0,01
200 000 CAD	Province of Manitoba Canada, 2.050%, 05/09/52	100 240	0,00	400 000 GBP	Province of Ontario Canada, 0.250%, 15/12/26	455 460	0,01
400 000 CAD	Province of New Brunswick Canada, 1.800%, 14/08/25	292 368	0,00	300 000 AUD	Province of Ontario Canada, 3.500%, 27/01/27	198 764	0,00
400 000 CAD	Province of New Brunswick Canada, 3.100%, 14/08/28	297 497	0,00	500 000 CAD	Province of Ontario Canada, 1.850%, 01/02/27	359 453	0,01
100 000 CAD	Province of New Brunswick Canada, 5.650%, 27/12/28	83 050	0,00	400 000 EUR	Province of Ontario Canada, 0.375%, 08/04/27	410 978	0,01
200 000 CAD	Province of New Brunswick Canada, 3.100%, 14/08/48	127 804	0,00	1 500 000 USD	Province of Ontario Canada, 3.100%, 19/05/27	1 448 835	0,02
200 000 CAD	Province of New Brunswick Canada, 3.050%, 14/08/50	126 357	0,00	300 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.600%, 02/06/27	220 177	0,00
200 000 CAD	Province of Newfoundland and Labrador Canada, 3.000%, 02/06/26	148 483	0,00	700 000 CAD	Province of Ontario Canada, 1.050%, 08/09/27	485 408	0,01
100 000 CAD	Province of Newfoundland and Labrador Canada, 1.250%, 02/06/27	69 914	0,00	500 000 CAD	Province of Ontario Canada, 3.600%, 08/03/28	380 210	0,01
300 000 CAD	Province of Newfoundland and Labrador Canada, 2.850%, 02/06/28	220 220	0,00	500 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.900%, 02/06/28	369 718	0,01
500 000 CAD	Province of Newfoundland and Labrador Canada, 4.150%, 02/06/33	385 443	0,01	1 000 000 CAD	Province of Ontario Canada, 3.400%, 08/09/28	755 013	0,01
100 000 CAD	Province of Newfoundland and Labrador Canada, 5.600%, 17/10/33	85 629	0,00	800 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.700%, 02/06/29	582 867	0,01
200 000 CAD	Province of Newfoundland and Labrador Canada, 3.300%, 17/10/46	128 256	0,00	500 000 USD	Province of Ontario Canada, 2.000%, 02/10/29	446 570	0,01
100 000 CAD	Province of Newfoundland and Labrador Canada, 3.700%, 17/10/48	68 259	0,00	900 000 CAD	Province of Ontario Canada, 1.550%, 01/11/29	612 500	0,01
200 000 CAD	Province of Newfoundland and Labrador Canada, 2.650%, 17/10/50	111 761	0,00	600 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.050%, 02/06/30	416 032	0,01
600 000 CAD	Province of Nova Scotia Canada, 1.100%, 01/06/28	410 194	0,01	500 000 USD	Province of Ontario Canada, 1.125%, 07/10/30	410 420	0,01
200 000 CAD	Province of Nova Scotia Canada, 4.400%, 01/06/42	156 709	0,00	1 300 000 CAD	Province of Ontario Canada, 1.350%, 02/12/30	852 374	0,01
200 000 CAD	Province of Nova Scotia Canada, 3.450%, 01/06/45	137 183	0,00	500 000 USD	Province of Ontario Canada, 1.600%, 25/02/31	420 945	0,01
				1 000 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.150%, 02/06/31	685 742	0,01
				700 000 CAD	Province of Ontario Canada, 6.200%, 02/06/31	618 969	0,01
				1 500 000 USD	Province of Ontario Canada, 1.800%, 14/10/31	1 264 335	0,02
				1 100 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.250%, 02/12/31	753 925	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Canada (suite)				Canada (suite)			
1 000 000 CAD	Province of Ontario Canada, 4.050%, 02/02/32	779 046	0,01	1 000 000 USD	Province of Quebec Canada, 3.625%, 13/04/28	980 840	0,01
1 500 000 CAD	Province of Ontario Canada, 3.750%, 02/06/32	1 141 847	0,02	200 000 EUR	Province of Quebec Canada, 0.875%, 05/07/28	204 382	0,00
1 400 000 CAD	Province of Ontario Canada, 5.850%, 08/03/33	1 230 176	0,02	500 000 CAD	Province of Quebec Canada, 2.750%, 01/09/28	367 227	0,01
1 500 000 CAD	Province of Ontario Canada, 3.650%, 02/06/33	1 127 696	0,02	600 000 CAD	Province of Quebec Canada, 2.300%, 01/09/29	427 258	0,01
300 000 CAD	Province of Ontario Canada, 5.600%, 02/06/35	263 657	0,00	200 000 USD	Province of Quebec Canada, 7.500%, 15/09/29	233 542	0,00
900 000 CAD	Province of Ontario Canada, 4.700%, 02/06/37	737 562	0,01	100 000 USD	Province of Quebec Canada, 1.350%, 28/05/30	84 294	0,00
300 000 CAD	Province of Ontario Canada, 4.600%, 02/06/39	244 270	0,00	1 000 000 CAD	Province of Quebec Canada, 1.900%, 01/09/30	684 757	0,01
1 200 000 CAD	Province of Ontario Canada, 4.650%, 02/06/41	982 761	0,01	300 000 EUR	Province of Quebec Canada, 0.250%, 05/05/31	276 831	0,00
600 000 CAD	Province of Ontario Canada, 3.500%, 02/06/43	422 566	0,01	700 000 CAD	Province of Quebec Canada, 2.100%, 27/05/31	480 482	0,01
800 000 CAD	Province of Ontario Canada, 3.450%, 02/06/45	556 912	0,01	500 000 CAD	Province of Quebec Canada, 1.500%, 01/09/31	325 743	0,01
1 700 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.900%, 02/12/46	1 077 217	0,02	500 000 EUR	Province of Quebec Canada, 0.500%, 25/01/32	461 048	0,01
200 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.800%, 02/06/48	123 645	0,00	1 400 000 CAD	Province of Quebec Canada, 3.650%, 20/05/32	1 062 040	0,02
1 100 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.900%, 02/06/49	690 941	0,01	100 000 CAD	Province of Quebec Canada, 6.250%, 01/06/32	89 547	0,00
1 400 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.650%, 02/12/50	834 659	0,01	1 000 000 CAD	Province of Quebec Canada, 3.250%, 01/09/32	733 793	0,01
1 500 000 CAD	Province of Ontario Canada, 1.900%, 02/12/51	753 140	0,01	1 800 000 CAD	Province of Quebec Canada, 3.900%, 22/11/32	1 388 427	0,02
800 000 CAD	Province of Ontario Canada, 2.550%, 02/12/52	465 124	0,01	500 000 EUR	Province of Quebec Canada, 3.000%, 24/01/33	558 373	0,01
1 700 000 CAD	Province of Ontario Canada, 3.750%, 02/12/53	1 254 978	0,02	3 000 000 CAD	Province of Quebec Canada, 3.600%, 01/09/33	2 249 044	0,03
1 500 000 CAD	Province of Ontario Canada, 4.150%, 02/12/54	1 188 636	0,02	2 000 000 USD	Province of Quebec Canada, 4.500%, 08/09/33	2 028 180	0,03
500 000 EUR	Province of Ontario Canada, 0.250%, perpetual	458 270	0,01	300 000 CAD	Province of Quebec Canada, 5.000%, 01/12/38	254 736	0,00
500 000 EUR	Province of Quebec Canada, 0.200%, 07/04/25	532 392	0,01	200 000 CAD	Province of Quebec Canada, 5.000%, 01/12/41	170 854	0,00
400 000 CAD	Province of Quebec Canada, 2.600%, 06/07/25	296 417	0,00	300 000 CAD	Province of Quebec Canada, 4.250%, 01/12/43	234 883	0,00
150 000 USD	Province of Quebec Canada, 0.600%, 23/07/25	141 045	0,00	800 000 CAD	Province of Quebec Canada, 3.500%, 01/12/45	562 190	0,01
900 000 CAD	Province of Quebec Canada, 2.750%, 01/09/25	667 792	0,01	1 050 000 CAD	Province of Quebec Canada, 3.500%, 01/12/48	736 800	0,01
200 000 EUR	Province of Quebec Canada, 1.125%, 28/10/25	214 262	0,00	700 000 CAD	Province of Quebec Canada, 3.100%, 01/12/51	457 644	0,01
600 000 USD	Province of Quebec Canada, 2.500%, 20/04/26	575 994	0,01	500 000 CAD	Province of Quebec Canada, 2.850%, 01/12/53	309 992	0,00
200 000 CAD	Province of Quebec Canada, 2.500%, 01/09/26	147 067	0,00	500 000 CAD	Province of Quebec Canada, 4.400%, 01/12/55	414 997	0,01
100 000 GBP	Province of Quebec Canada, 2.250%, 15/09/26	121 182	0,00	200 000 CAD	Province of Saskatchewan Canada, 0.800%, 02/09/25	143 668	0,00
1 000 000 CAD	Province of Quebec Canada, 1.850%, 13/02/27	719 710	0,01	100 000 CAD	Province of Saskatchewan Canada, 3.050%, 02/12/28	74 217	0,00
400 000 CAD	Province of Quebec Canada, 2.750%, 01/09/27	295 334	0,00	700 000 CAD	Province of Saskatchewan Canada, 2.150%, 02/06/31	479 372	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Canada (suite)				Chili (suite)			
1 000 000 CAD	Province of Saskatchewan Canada, 3.900%, 02/06/33	766 100	0,01	200 000 USD	Chile Government International Bond, 3.860%, 21/06/47	163 700	0,00
200 000 CAD	Province of Saskatchewan Canada, 3.900%, 02/06/45	148 324	0,00	500 000 USD	Chile Government International Bond, 3.500%, 15/04/53	376 865	0,01
200 000 CAD	Province of Saskatchewan Canada, 3.300%, 02/06/48	134 437	0,00	1 000 000 USD	Chile Government International Bond, 5.330%, 05/01/54	994 430	0,01
200 000 CAD	Province of Saskatchewan Canada, 3.100%, 02/06/50	129 637	0,00	500 000 USD	Chile Government International Bond, 3.100%, 22/01/61	334 465	0,00
300 000 CAD	Province of Saskatchewan Canada, 2.950%, 02/06/58	185 071	0,00	500 000 USD	Chile Government International Bond, 3.250%, 21/09/71	334 130	0,00
200 000 CAD	PSP Capital Inc, 3.000%, 05/11/25	148 706	0,00	500 000 EUR	Chile Government International Bond, 1.300%, perpetual	419 524	0,01
500 000 CAD	PSP Capital Inc, 1.500%, 15/03/28	349 018	0,01				
150 000 CAD	PSP Capital Inc, 2.050%, 15/01/30	104 342	0,00	Chili – Total		8 591 261	0,13
100 000 CAD	Regional Municipality of York, 2.500%, 02/06/26	73 394	0,00	Chine			
500 000 CAD	South Coast British Columbia Transportation Authority, 1.600%, 03/07/30	335 185	0,01	50 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 2.250%, 22/04/25	7 044 993	0,10
Canada – Total		1 711 981 270	2,58	55 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 3.450%, 23/09/25	7 897 148	0,12
Chili				45 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 3.350%, 24/03/26	6 485 477	0,10
500 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 2.500%, 01/03/25	548 888	0,01	50 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 3.630%, 19/07/26	7 271 721	0,11
600 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.500%, 01/03/26	675 969	0,01	60 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 2.870%, 14/05/27	8 570 571	0,13
500 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 2.300%, 01/10/28	499 661	0,01	87 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 3.750%, 25/01/29	12 952 968	0,19
400 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.700%, 01/09/30	442 209	0,01	60 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 3.740%, 12/07/29	8 952 539	0,13
240 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.000%, 01/03/35	269 069	0,00	60 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 2.960%, 17/04/30	8 615 070	0,13
300 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 6.000%, 01/01/43	372 655	0,01	40 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 3.790%, 26/10/30	6 027 298	0,09
500 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.100%, 15/07/50	555 971	0,01	40 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 3.520%, 24/05/31	5 939 370	0,09
117 000 USD	Chile Government International Bond, 3.125%, 21/01/26	113 412	0,00	50 000 000 CNY	Agricultural Development Bank of China, 2.970%, 14/10/32	7 162 517	0,11
300 000 EUR	Chile Government International Bond, 0.830%, 02/07/31	274 438	0,00	80 000 000 CNY	China Development Bank, 3.230%, 10/01/25	11 396 407	0,17
300 000 USD	Chile Government International Bond, 2.550%, 27/01/32	257 667	0,00	44 000 000 CNY	China Development Bank, 4.730%, 02/04/25	6 390 987	0,10
500 000 USD	Chile Government International Bond, 2.550%, 27/07/33	413 195	0,01	55 000 000 CNY	China Development Bank, 2.890%, 22/06/25	7 818 900	0,12
198 572 EUR	Chile Government International Bond, 4.125%, 05/07/34	224 158	0,00	55 000 000 CNY	China Development Bank, 3.340%, 14/07/25	7 872 874	0,12
500 000 USD	Chile Government International Bond, 4.950%, 05/01/36	494 360	0,01	60 000 000 CNY	China Development Bank, 3.680%, 26/02/26	8 698 909	0,13
500 000 USD	Chile Government International Bond, 3.100%, 07/05/41	379 760	0,01	45 000 000 CNY	China Development Bank, 3.300%, 03/03/26	6 474 881	0,10
500 000 USD	Chile Government International Bond, 4.340%, 07/03/42	446 735	0,01	50 000 000 CNY	China Development Bank, 3.430%, 14/01/27	7 260 723	0,11
				20 000 000 CNY	China Development Bank, 2.690%, 16/06/27	2 842 870	0,04
				60 500 000 CNY	China Development Bank, 4.880%, 09/02/28	9 310 527	0,14
				60 000 000 CNY	China Development Bank, 3.480%, 08/01/29	8 822 594	0,13

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
80 000 000 CNY	China Development Bank, 3.450%, 20/09/29	11 792 561	0,18	40 000 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 22/11/28	5 868 250	0,09
50 000 000 CNY	China Development Bank, 3.070%, 10/03/30	7 217 154	0,11	30 000 000 CNY	China Government Bond, 3.290%, 23/05/29	4 417 219	0,07
35 000 000 CNY	China Development Bank, 3.090%, 18/06/30	5 054 722	0,08	40 000 000 CNY	China Government Bond, 3.130%, 21/11/29	5 843 546	0,09
50 000 000 CNY	China Development Bank, 3.660%, 01/03/31	7 484 349	0,11	110 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 25/03/30	15 735 512	0,24
10 000 000 CNY	China Development Bank, 3.410%, 07/06/31	1 475 170	0,02	30 000 000 CNY	China Government Bond, 2.680%, 21/05/30	4 263 458	0,06
50 000 000 CNY	China Development Bank, 2.960%, 18/07/32	7 162 094	0,11	35 000 000 CNY	China Government Bond, 3.270%, 19/11/30	5 178 492	0,08
45 000 000 CNY	China Development Bank, 2.770%, 24/10/32	6 356 737	0,09	45 000 000 CNY	China Government Bond, 3.020%, 27/05/31	6 546 833	0,10
20 000 000 CNY	China Development Bank, 3.020%, 06/03/33	2 882 942	0,04	50 000 000 CNY	China Government Bond, 2.890%, 18/11/31	7 209 752	0,11
55 000 000 CNY	China Development Bank, 3.800%, 25/01/36	8 512 041	0,13	45 000 000 CNY	China Government Bond, 2.750%, 17/02/32	6 416 634	0,10
30 000 000 CNY	China Development Bank, 3.900%, 03/08/40	4 789 586	0,07	62 000 000 CNY	China Government Bond, 2.760%, 15/05/32	8 848 651	0,13
15 000 000 CNY	China Development Bank, 3.560%, 19/11/51	2 369 646	0,03	50 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 15/11/32	7 165 407	0,11
35 000 000 CNY	China Government Bond, 2.290%, 25/12/24	4 943 981	0,07	80 000 000 CNY	China Government Bond, 2.880%, 25/02/33	11 553 425	0,17
29 000 000 CNY	China Government Bond, 1.990%, 09/04/25	4 077 591	0,06	90 000 000 CNY	China Government Bond, 2.670%, 25/05/33	12 771 721	0,19
50 000 000 CNY	China Government Bond, 3.610%, 07/06/25	7 217 366	0,11	9 000 000 CNY	China Government Bond, 4.320%, 12/08/33	1 487 242	0,02
23 000 000 CNY	China Government Bond, 3.600%, 06/09/25	3 326 020	0,05	6 000 000 CNY	China Government Bond, 4.090%, 27/04/35	982 688	0,01
60 000 000 CNY	China Government Bond, 3.020%, 22/10/25	8 587 914	0,13	11 600 000 CNY	China Government Bond, 3.740%, 22/09/35	1 826 441	0,03
40 000 000 CNY	China Government Bond, 3.220%, 06/12/25	5 755 844	0,09	14 000 000 CNY	China Government Bond, 4.500%, 23/06/41	2 480 508	0,04
68 000 000 CNY	China Government Bond, 3.030%, 11/03/26	9 758 377	0,15	45 000 000 CNY	China Government Bond, 3.970%, 23/07/48	7 530 498	0,11
85 000 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 06/06/26	12 295 649	0,18	38 800 000 CNY	China Government Bond, 4.080%, 22/10/48	6 617 971	0,10
45 000 000 CNY	China Government Bond, 2.690%, 12/08/26	6 407 941	0,10	36 000 000 CNY	China Government Bond, 3.860%, 22/07/49	5 952 573	0,09
45 000 000 CNY	China Government Bond, 3.120%, 05/12/26	6 503 306	0,10	43 000 000 CNY	China Government Bond, 3.390%, 16/03/50	6 597 452	0,10
100 000 000 CNY	China Government Bond, 2.370%, 20/01/27	14 109 726	0,21	35 000 000 CNY	China Government Bond, 3.810%, 14/09/50	5 761 907	0,09
44 000 000 CNY	China Government Bond, 2.850%, 04/06/27	6 303 449	0,09	24 000 000 CNY	China Government Bond, 3.720%, 12/04/51	3 900 736	0,06
65 000 000 CNY	China Government Bond, 2.500%, 25/07/27	9 207 249	0,14	38 000 000 CNY	China Government Bond, 3.320%, 15/04/52	5 787 175	0,09
110 000 000 CNY	China Government Bond, 2.440%, 15/10/27	15 541 017	0,23	22 000 000 CNY	China Government Bond, 3.730%, 25/05/70	3 738 964	0,06
85 000 000 CNY	China Government Bond, 3.280%, 03/12/27	12 434 195	0,19	15 000 000 CNY	China Government Bond, 3.760%, 22/03/71	2 568 223	0,04
18 000 000 CNY	China Government Bond, 3.690%, 17/05/28	2 700 178	0,04	25 000 000 CNY	China Government Bond, 3.400%, 15/07/72	3 951 277	0,06
55 000 000 CNY	China Government Bond, 2.400%, 15/07/28	7 757 170	0,12	25 000 000 CNY	China Government Bond, 3.270%, 25/03/73	3 848 242	0,06
18 000 000 CNY	China Government Bond, 3.540%, 16/08/28	2 678 097	0,04	200 000 EUR	China Government International Bond, 0.125%, 12/11/26	202 993	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Chine (suite)				Chypre			
300 000 USD	China Government International Bond, 2.125%, 03/12/29	273 312	0,00	500 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 0.010%, 09/02/26	522 201	0,01
200 000 EUR	China Government International Bond, 0.625%, 17/11/33	173 333	0,00	300 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 0.625%, 21/01/30	292 927	0,01
100 000 EUR	China Government International Bond, 1.000%, 12/11/39	76 919	0,00	200 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 2.250%, 16/04/50	165 039	0,00
500 000 EUR	CHINA Government International BOND, 0.625%, perpetual	410 604	0,01	Chypre – Total			
40 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 2.930%, 02/03/25	5 681 791	0,08	980 167 0,02			
40 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 3.220%, 14/05/26	5 748 512	0,09	République tchèque			
35 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 2.610%, 27/01/27	4 959 427	0,07	15 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.250%, 14/02/25	645 233	0,01
40 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 3.260%, 24/02/27	5 778 122	0,09	3 500 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.400%, 17/09/25	151 168	0,00
200 000 USD	Export-Import Bank of China, 3.375%, 14/03/27	194 944	0,00	12 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.000%, 26/06/26	497 072	0,01
40 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 2.820%, 17/06/27	5 707 115	0,08	8 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.250%, 10/02/27	319 247	0,01
60 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 3.860%, 20/05/29	8 976 481	0,13	5 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.500%, 25/08/28	211 986	0,00
40 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 3.230%, 23/03/30	5 815 290	0,09	20 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.500%, 12/12/28	969 270	0,02
20 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 3.740%, 16/11/30	3 001 410	0,04	6 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.750%, 23/07/29	254 697	0,00
10 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 3.380%, 16/07/31	1 470 531	0,02	5 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.050%, 29/11/29	180 641	0,00
40 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 2.900%, 19/08/32	5 701 982	0,08	9 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.950%, 15/05/30	339 937	0,01
30 000 000 CNY	Export-Import Bank of China, 3.100%, 13/02/33	4 343 955	0,06	27 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.200%, 13/03/31	1 017 139	0,02
Chine – Total		591 878 934	8,87	15 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.750%, 23/06/32	576 964	0,01
Colombie				3 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.000%, 13/10/33	115 127	0,00
6 700 000 000 COP	Colombian TES, 6.250%, 26/11/25	1 640 065	0,03	30 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 3.500%, 30/05/35	1 302 453	0,02
12 500 000 000 COP	Colombian TES, 5.750%, 03/11/27	2 853 640	0,04	5 500 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.200%, 04/12/36	255 480	0,00
4 000 000 000 COP	Colombian TES, 7.000%, 26/03/31	890 459	0,01	15 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.950%, 30/07/37	538 157	0,01
4 000 000 000 COP	Colombian TES, 7.000%, 26/03/31	891 337	0,01	7 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.500%, 24/04/40	223 512	0,00
3 000 000 000 COP	Colombian TES, 7.250%, 18/10/34	637 674	0,01	1 500 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.850%, 26/11/57	75 483	0,00
Colombie – Total		6 913 175	0,10	République tchèque – Total			
Croatie				7 673 566 0,12			
400 000 EUR	Croatia Government International Bond, 1.125%, 19/06/29	402 588	0,01	Danemark			
100 000 EUR	Croatia Government International Bond, 1.500%, 17/06/31	99 221	0,00	4 000 000 DKK	Denmark Government Bond, 1.750%, 15/11/25	585 269	0,01
800 000 EUR	Croatia Government International Bond, 2.875%, 22/04/32	866 982	0,01	7 100 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.500%, 15/11/27	991 055	0,02
Croatie – Total		1 368 791	0,02	8 500 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.500%, 15/11/29	1 151 018	0,02
				18 000 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.010%, 15/11/31	2 258 712	0,03
				10 000 000 DKK	Denmark Government Bond, 2.250%, 15/11/33	1 481 207	0,02
				7 350 000 DKK	Denmark Government Bond, 4.500%, 15/11/39	1 390 906	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Danemark (suite)				Finlande (suite)			
7 300 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.250%, 15/11/52	616 281	0,01	300 000 EUR	Finland Government Bond, 0.125%, 15/04/52	163 978	0,00
100 000 GBP	Kommunekredit, 4.250%, 17/11/25	127 303	0,00	500 000 EUR	Finnvera Oyj, 2.125%, 08/03/28	545 874	0,01
500 000 USD	Kommunekredit, 0.500%, 28/01/26	461 495	0,01	200 000 EUR	Finnvera OYJ, 1.125%, 17/05/32	197 465	0,00
500 000 EUR	Kommunekredit, 1.500%, 16/05/29	526 360	0,01	100 000 GBP	Kuntarahoitus Oyj, 1.125%, 19/06/25	121 005	0,00
200 000 EUR	Kommunekredit, 0.875%, 03/11/36	175 341	0,00	300 000 EUR	Kuntarahoitus Oyj, 0.010%, 21/04/28	298 451	0,00
400 000 EUR	Kommunekredit, 0.125%, 26/09/40	281 491	0,00	500 000 EUR	Kuntarahoitus Oyj, 3.000%, 25/09/28	565 504	0,01
Danemark – Total		10 046 438	0,15	800 000 EUR	Kuntarahoitus Oyj, 3.125%, 29/07/30	915 039	0,01
Finlande				200 000 EUR	Kuntarahoitus Oyj, 0.010%, 14/10/30	186 856	0,00
206 000 EUR	Finland Government Bond, 4.000%, 04/07/25	232 018	0,00	500 000 EUR	Kuntarahoitus Oyj, 0.250%, 25/02/32	457 866	0,01
300 000 EUR	Finland Government Bond, 0.875%, 15/09/25	322 394	0,00	Finlande – Total		15 624 243	0,23
500 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/04/26	529 370	0,01	France			
700 000 EUR	Finland Government Bond, 0.010%, 15/09/26	726 357	0,01	200 000 EUR	Action Logement Services, 3.125%, 28/09/37	216 997	0,00
500 000 EUR	Finland Government Bond, 1.375%, 15/04/27	535 777	0,01	300 000 EUR	Action Logement Services, 0.750%, 19/07/41	218 459	0,00
1 100 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/27	1 141 188	0,02	200 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 0.010%, 25/03/25	212 539	0,00
1 100 000 EUR	Finland Government Bond, 2.750%, 04/07/28	1 240 754	0,02	200 000 GBP	Agence Francaise de Developpement EPIC, 1.250%, 18/06/25	242 197	0,00
200 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/28	203 474	0,00	400 000 USD	Agence Francaise de Developpement EPIC, 0.625%, 22/01/26	370 264	0,01
800 000 EUR	Finland Government Bond, 2.875%, 15/04/29	908 464	0,01	100 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 0.250%, 21/07/26	103 772	0,00
800 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/29	799 899	0,01	100 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 3.750%, 15/02/27	113 912	0,00
400 000 EUR	Finland Government Bond, 0.010%, 15/09/30	377 684	0,01	400 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 0.010%, 25/11/28	388 470	0,01
500 000 EUR	Finland Government Bond, 0.750%, 15/04/31	492 414	0,01	200 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 0.250%, 29/06/29	193 665	0,00
300 000 EUR	Finland Government Bond, 0.125%, 15/09/31	277 799	0,00	900 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 2.875%, 21/01/30	1 004 376	0,02
500 000 EUR	Finland Government Bond, 1.500%, 15/09/32	509 443	0,01	400 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 0.125%, 29/09/31	360 293	0,01
800 000 EUR	Finland Government Bond, 3.000%, 15/09/33	916 621	0,01	200 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 1.375%, 05/07/32	197 021	0,00
700 000 EUR	Finland Government Bond, 1.125%, 15/04/34	672 160	0,01	500 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 3.500%, 25/02/33	579 742	0,01
500 000 EUR	Finland Government Bond, 0.125%, 15/04/36	404 429	0,01	500 000 EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 1.125%, 02/03/37	435 216	0,01
300 000 EUR	Finland Government Bond, 2.750%, 15/04/38	330 686	0,01				
600 000 EUR	Finland Government Bond, 0.250%, 15/09/40	440 345	0,01				
305 000 EUR	Finland Government Bond, 2.625%, 04/07/42	328 057	0,00				
500 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/04/43	362 635	0,01				
500 000 EUR	Finland Government Bond, 1.375%, 15/04/47	420 237	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
200 000 EUR	Agence France Locale, 1.125%, 20/06/28	206 470	0,00	700 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.450%, 19/01/32	652 828	0,01
300 000 EUR	Agence France Locale, 3.000%, 20/03/30	335 551	0,01	100 000 EUR	Caisse des Depots et Consignations, 0.750%, 18/09/28	101 594	0,00
200 000 EUR	Agence France Locale, 0.010%, 20/03/31	180 685	0,00	500 000 EUR	Caisse des Depots et Consignations, 3.125%, 25/05/33	571 756	0,01
600 000 EUR	Bpifrance SACA, 0.125%, 25/03/25	638 539	0,01	200 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.500%, 16/01/25	214 424	0,00
100 000 EUR	Bpifrance SACA, 2.750%, 25/10/25	110 192	0,00	100 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 1.125%, 09/09/25	107 016	0,00
200 000 EUR	Bpifrance SACA, 0.125%, 26/02/27	204 444	0,00	100 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.500%, 19/01/26	105 275	0,00
600 000 EUR	Bpifrance SACA, 2.125%, 29/11/27	651 364	0,01	200 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.750%, 11/01/27	208 114	0,00
400 000 EUR	Bpifrance SACA, 0.010%, 25/05/28	395 778	0,01	300 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.500%, 19/02/27	309 155	0,01
600 000 EUR	Bpifrance SACA, 0.125%, 25/11/28	588 014	0,01	500 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.010%, 01/10/29	472 216	0,01
200 000 EUR	Bpifrance SACA, 0.050%, 26/09/29	190 886	0,00	700 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 2.875%, 30/01/30	777 237	0,01
500 000 EUR	Bpifrance SACA, 3.125%, 25/05/33	569 911	0,01	500 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.010%, 24/06/30	462 793	0,01
500 000 USD	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.375%, 23/09/25	466 000	0,01	100 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 1.500%, 13/01/31	101 534	0,00
1 000 000 USD	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 4.625%, 02/11/25	1 002 420	0,02	400 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.010%, 18/03/31	362 215	0,01
100 000 GBP	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.125%, 15/12/25	117 734	0,00	500 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.375%, 20/01/32	455 039	0,01
250 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 4.000%, 15/12/25	282 473	0,00	100 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 1.250%, 22/01/35	92 776	0,00
500 000 USD	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 4.000%, 25/01/26	496 415	0,01	100 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 1.500%, 28/06/38	90 433	0,00
700 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.010%, 25/02/26	730 819	0,01	100 000 EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.500%, 01/10/46	64 723	0,00
500 000 USD	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 1.250%, 28/10/26	460 940	0,01	3 700 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/25	3 954 698	0,06
700 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.010%, 25/11/26	719 127	0,01	4 300 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/03/25	4 587 926	0,07
500 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 1.750%, 25/11/27	536 871	0,01	4 600 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/25	4 930 727	0,07
700 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 3.000%, 25/05/28	788 790	0,01	3 730 128 EUR	French Republic Government Bond OAT, 6.000%, 25/10/25	4 372 372	0,07
900 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.010%, 25/05/29	869 644	0,01	3 200 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/11/25	3 441 418	0,05
800 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.600%, 25/11/29	791 036	0,01	4 550 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/26	4 780 781	0,07
800 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 3.125%, 01/03/30	913 581	0,01	4 483 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/04/26	5 078 525	0,08
300 000 USD	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 1.000%, 21/10/30	244 533	0,00	6 150 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/26	6 505 889	0,10
400 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.010%, 25/11/30	371 308	0,01	4 000 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 24/09/26	4 437 115	0,07
500 000 USD	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 1.375%, 20/01/31	415 395	0,01	3 850 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.250%, 25/11/26	4 016 952	0,06
400 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 0.010%, 25/05/31	365 449	0,01	3 850 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/27	3 966 045	0,06
1 300 000 EUR	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 3.000%, 25/11/31	1 474 431	0,02	5 400 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/05/27	5 725 969	0,09

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
5 000 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.750%, 25/10/27	5 626 094	0,08	2 650 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/53	1 644 511	0,03
5 250 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/02/28	5 465 077	0,08	1 900 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.000%, 25/05/54	2 062 546	0,03
6 200 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/28	6 432 490	0,10	1 682 493 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/04/55	2 196 398	0,03
6 100 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/11/28	6 283 863	0,09	1 958 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/04/60	2 590 857	0,04
2 808 030 EUR	French Republic Government Bond OAT, 5.500%, 25/04/29	3 595 712	0,05	1 750 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.750%, 25/05/66	1 384 436	0,02
5 200 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/29	5 244 265	0,08	2 500 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/72	1 158 778	0,02
4 600 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/29	4 458 615	0,07	9 500 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.750%, perpetual	10 746 981	0,16
6 000 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 25/05/30	6 712 274	0,10	3 500 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.000%, perpetual	4 022 125	0,06
5 300 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/30	5 006 600	0,08	500 000 EUR	Gestion Securite de Stocks Securite SA, 3.500%, 25/11/29	574 761	0,01
5 150 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.500%, 25/05/31	5 370 879	0,08	500 000 EUR	Ile-de-France Mobilites, 3.050%, 03/02/33	561 129	0,01
4 800 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/31	4 404 002	0,07	100 000 EUR	Regie Autonome des Transports Parisiens EPIC, 3.750%, 19/10/26	113 517	0,00
3 200 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/05/32	2 891 426	0,04	200 000 EUR	Regie Autonome des Transports Parisiens EPIC, 0.350%, 20/06/29	195 176	0,00
3 408 599 EUR	French Republic Government Bond OAT, 5.750%, 25/10/32	4 732 316	0,07	100 000 EUR	Region of Ile de France, 0.625%, 23/04/27	103 427	0,00
5 100 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.000%, 25/11/32	5 425 888	0,08	200 000 EUR	Region of Ile de France, 0.010%, 20/04/28	197 595	0,00
2 100 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/11/33	2 508 803	0,04	500 000 EUR	Region of Ile de France, 2.900%, 30/04/31	557 125	0,01
6 500 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/34	6 310 844	0,09	100 000 EUR	Region of Ile de France, 1.375%, 20/06/33	96 778	0,00
1 750 484 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.750%, 25/04/35	2 327 852	0,04	200 000 EUR	SFIL SA, 0.750%, 06/02/26	211 898	0,00
5 100 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/36	4 766 969	0,07	700 000 EUR	SFIL SA, 3.250%, 25/11/30	798 579	0,01
2 000 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.250%, 25/05/38	1 798 282	0,03	300 000 EUR	SFIL SA, 0.050%, perpetual	288 337	0,00
2 840 066 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.000%, 25/10/38	3 589 016	0,05	200 000 EUR	Sncf Reseau, 2.000%, 05/02/48	166 475	0,00
2 650 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.750%, 25/06/39	2 545 981	0,04	100 000 EUR	SNCF Reseau, 4.250%, 07/10/26	114 968	0,00
3 950 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/40	3 022 461	0,05	200 000 EUR	SNCF Reseau, 1.125%, 19/05/27	210 162	0,00
3 871 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 4.500%, 25/04/41	5 215 175	0,08	200 000 EUR	SNCF Reseau, 3.125%, 25/10/28	225 658	0,00
1 700 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 25/05/43	1 747 954	0,03	600 000 EUR	SNCF Reseau, 0.875%, 22/01/29	607 851	0,01
1 450 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/06/44	1 003 940	0,02	200 000 EUR	SNCF Reseau, 1.125%, 25/05/30	200 660	0,00
2 850 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.250%, 25/05/45	3 286 052	0,05	59 000 EUR	SNCF Reseau, 5.000%, 10/10/33	76 143	0,00
3 920 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.000%, 25/05/48	3 583 004	0,05	100 000 GBP	SNCF Reseau, 5.250%, 31/01/35	137 625	0,00
3 600 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.500%, 25/05/50	2 890 096	0,04	400 000 EUR	SNCF Reseau, 0.750%, 25/05/36	335 650	0,01
2 900 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/52	1 837 551	0,03	200 000 EUR	SNCF Reseau, 1.500%, 29/05/37	181 598	0,00
				100 000 GBP	SNCF Reseau, 4.830%, 25/03/60	129 080	0,00
				400 000 EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 0.010%, 25/11/30	367 835	0,01
				500 000 EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 0.300%, 25/11/31	456 331	0,01
				200 000 EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 1.125%, 25/05/34	184 375	0,00
				300 000 EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 0.875%, 10/05/46	201 067	0,00
				500 000 EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 3.700%, 25/05/53	577 384	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
France (suite)				Allemagne (suite)			
400 000 EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 0.700%, 15/10/60	188 285	0,00	2 300 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/27	2 406 166	0,04
300 000 EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 1.000%, 18/02/70	147 739	0,00	573 522 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.500%, 04/07/27	728 008	0,01
600 000 EUR	Societe Nationale SNCF SACA, 1.500%, 02/02/29	623 394	0,01	2 350 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/08/27	2 464 548	0,04
300 000 EUR	Societe Nationale SNCF SACA, 1.000%, 25/05/40	232 908	0,00	3 500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/27	3 586 048	0,05
400 000 EUR	Societe Nationale SNCF SACA, 0.875%, 28/02/51	229 794	0,00	479 432 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.625%, 04/01/28	603 553	0,01
400 000 EUR	Unedic Asseo, 0.100%, 25/11/26	411 827	0,01	2 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/28	2 086 839	0,03
300 000 EUR	Unedic Asseo, 1.250%, 28/03/27	318 109	0,01	500 185 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/28	618 794	0,01
100 000 EUR	Unedic Asseo, 1.250%, 21/10/27	105 447	0,00	2 350 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/08/28	2 409 826	0,04
900 000 EUR	Unedic Asseo, 0.010%, 25/11/28	882 051	0,01	4 150 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/28	4 184 135	0,06
300 000 EUR	Unedic Asseo, 0.500%, 20/03/29	299 876	0,00	2 700 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/29	2 749 021	0,04
300 000 EUR	Unedic Asseo, 0.250%, 25/11/29	291 455	0,00	3 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/29	2 986 433	0,04
400 000 EUR	Unedic Asseo, 0.010%, 05/03/30	379 584	0,01	2 500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.100%, 15/11/29	2 789 545	0,04
300 000 EUR	Unedic Asseo, 0.010%, 25/11/31	271 847	0,00	992 071 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.250%, 04/01/30	1 361 919	0,02
500 000 EUR	Unedic Asseo, 0.100%, 25/05/34	423 722	0,01	2 100 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/30	2 068 396	0,03
400 000 EUR	Unedic Asseo, 0.250%, 16/07/35	333 485	0,01	2 300 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/30	2 246 178	0,03
1 000 000 EUR	UNEDIC ASSEO, 0.010%, 25/05/31	919 213	0,01	3 200 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/30	3 128 192	0,05
400 000 EUR	UNEDIC ASSEO, 1.750%, 25/11/32	412 927	0,01	1 500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.400%, 15/11/30	1 706 187	0,03
100 000 EUR	Ville de Paris, 1.750%, 25/05/31	103 330	0,00	1 981 855 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.500%, 04/01/31	2 698 193	0,04
France – Total		239 039 558	3,58	2 300 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/31	2 222 270	0,03
Allemagne				3 250 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/31	3 108 499	0,05
2 500 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 11/04/25	2 668 117	0,04	1 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/31	956 848	0,01
5 000 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/10/25	5 296 245	0,08	2 700 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/32	2 551 695	0,04
1 200 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/10/25	1 275 089	0,02	2 500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.700%, 15/08/32	2 703 880	0,04
3 500 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/04/26	3 679 805	0,06	4 500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.300%, 15/02/33	5 097 137	0,08
4 100 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 09/10/26	4 274 577	0,06	2 500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.600%, 15/08/33	2 899 458	0,04
2 100 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 16/04/27	2 172 878	0,03	1 299 783 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/34	1 796 552	0,03
3 000 000 EUR	Bundesobligation, 1.300%, 15/10/27	3 235 774	0,05	2 200 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/05/35	1 915 070	0,03
2 000 000 EUR	Bundesobligation, 1.300%, 15/10/27	2 162 529	0,03	3 600 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/05/36	3 050 637	0,05
1 600 000 EUR	Bundesobligation, 2.200%, 13/04/28	1 784 390	0,03	1 666 530 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.000%, 04/01/37	2 216 004	0,03
5 000 000 EUR	Bundesobligation, 2.400%, 19/10/28	5 637 858	0,08				
1 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/25	1 076 095	0,02				
4 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.000%, 15/08/25	4 312 245	0,06				
3 200 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/26	3 406 317	0,05				
3 700 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/26	3 869 276	0,06				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
2 100 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.000%, 15/05/38	1 973 030	0,03	500 000 EUR	Land Baden-Wuerttemberg, 0.010%, 04/08/27	506 626	0,01
1 355 626 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.250%, 04/07/39	1 885 628	0,03	200 000 EUR	Land Baden-Wuerttemberg, 0.010%, 07/03/31	185 047	0,00
2 550 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/40	3 772 167	0,06	100 000 EUR	Land Baden-Wuerttemberg, 3.000%, 27/06/33	114 845	0,00
2 275 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 3.250%, 04/07/42	2 873 279	0,04	100 000 EUR	Land Berlin, 0.250%, 22/04/25	106 613	0,00
3 470 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.500%, 04/07/44	3 964 498	0,06	300 000 EUR	Land Berlin, 0.625%, 20/03/26	317 354	0,01
3 240 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.500%, 15/08/46	3 719 437	0,06	100 000 EUR	Land Berlin, 0.100%, 18/01/30	95 867	0,00
4 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.250%, 15/08/48	3 591 173	0,05	400 000 EUR	Land Berlin, 0.010%, 02/07/30	376 363	0,01
3 570 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/50	2 199 820	0,03	100 000 EUR	Land Berlin, 3.000%, 11/07/31	113 865	0,00
1 900 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/50	1 176 187	0,02	500 000 EUR	Land Berlin, 0.125%, 20/10/31	458 905	0,01
2 850 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/52	1 679 876	0,03	700 000 EUR	Land Berlin, 1.625%, 02/08/32	717 372	0,01
2 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.800%, 15/08/53	1 994 357	0,03	300 000 EUR	Land Berlin, 1.300%, 13/06/33	295 803	0,00
500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.800%, 15/08/53	499 959	0,01	500 000 EUR	Land Berlin, 0.150%, 22/02/36	404 573	0,01
2 500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.300%, perpetual	2 833 483	0,04	200 000 EUR	Land Berlin, 1.375%, 05/06/37	185 219	0,00
2 500 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.500%, 13/03/25	2 751 048	0,04	500 000 EUR	Land Berlin, 0.100%, 18/01/41	343 855	0,01
4 000 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 3.100%, 18/09/25	4 461 196	0,07	200 000 EUR	Land Thuringen, 0.500%, 02/03/27	207 683	0,00
2 000 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 3.100%, 12/12/25	2 238 485	0,03	300 000 EUR	Land Thuringen, 0.010%, 24/03/31	277 573	0,00
1 500 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.800%, perpetual	1 660 140	0,03	500 000 EUR	State of Brandenburg, 3.000%, 27/02/32	570 706	0,01
400 000 EUR	Free and Hanseatic City of Hamburg, 0.010%, 30/06/28	396 247	0,01	200 000 EUR	State of Brandenburg, 0.375%, 29/01/35	172 107	0,00
500 000 EUR	Free and Hanseatic City of Hamburg, 0.010%, 29/09/31	455 712	0,01	500 000 EUR	State of Brandenburg, 0.010%, perpetual	495 756	0,01
300 000 EUR	Free and Hanseatic City of Hamburg, 1.200%, 03/06/33	293 510	0,00	100 000 EUR	State of Bremen, 0.500%, 03/03/25	107 163	0,00
500 000 EUR	Free State of Bavaria, 0.030%, 03/04/28	499 655	0,01	300 000 EUR	State of Bremen, 0.010%, 06/07/27	304 128	0,00
300 000 EUR	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender, 0.375%, 17/04/25	320 419	0,01	200 000 EUR	State of Bremen, 1.000%, 25/02/28	208 121	0,00
400 000 EUR	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender, 0.010%, 08/10/27	403 582	0,01	200 000 EUR	State of Bremen, 0.450%, 15/03/29	199 526	0,00
200 000 EUR	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender, 0.625%, 13/02/29	201 853	0,00	300 000 EUR	State of Bremen, 0.400%, 20/08/49	176 034	0,00
300 000 EUR	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender, 0.010%, 25/09/29	288 327	0,00	300 000 EUR	State of Hesse, 0.010%, 10/03/25	319 644	0,01
200 000 EUR	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender, 0.010%, 04/02/31	185 418	0,00	300 000 EUR	State of Hesse, 0.625%, 02/08/28	305 639	0,00
300 000 EUR	Investitionsbank Schleswig-Holstein, 0.010%, 17/10/29	287 432	0,00	1 100 000 EUR	State of Hesse, 0.010%, 11/03/30	1 046 445	0,02
200 000 EUR	Land Baden-Wuerttemberg, 0.625%, 16/01/25	215 148	0,00	400 000 EUR	State of Hesse, 0.010%, 08/11/30	373 584	0,01
				400 000 EUR	State of Hesse, 2.875%, 04/07/33	453 362	0,01
				300 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.500%, 13/06/25	320 426	0,01
				300 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.010%, 17/03/26	313 029	0,00
				100 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.010%, 10/07/26	103 553	0,00
				500 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.010%, 08/09/26	516 048	0,01
				300 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.750%, 15/02/28	309 377	0,00
				400 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.010%, 26/05/28	396 949	0,01
				400 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.010%, 19/02/29	390 008	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)				
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)				
700 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.250%, 09/04/29	689 635	0,01	600 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 2.250%, 14/06/52	564 704	0,01	
300 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.375%, 14/05/29	297 013	0,00	500 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 2.900%, 15/01/53	536 225	0,01	
800 000 EUR	State of Lower Saxony, 2.750%, 17/02/31	897 630	0,01	300 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 1.750%, 11/07/68	230 101	0,00	
300 000 EUR	State of Lower Saxony, 0.010%, perpetual	297 470	0,00	350 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 2.150%, 21/03/19	282 219	0,00	
400 000 USD	State of North Rhine-Westphalia Germany, 3.875%, 15/01/25	395 644	0,01	400 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.950%, 10/01/21	201 325	0,00	
200 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 1.250%, 14/03/25	216 220	0,00	200 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 1.450%, 19/01/22	116 607	0,00	
100 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.010%, 05/05/25	106 194	0,00	200 000 EUR	State of Rhineland-Palatinate, 0.750%, 19/01/26	212 493	0,00	
300 000 GBP	State of North Rhine-Westphalia Germany, 2.125%, 13/06/25	368 381	0,01	300 000 EUR	State of Rhineland-Palatinate, 0.700%, 26/01/28	309 062	0,00	
300 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.750%, 16/01/26	318 762	0,01	400 000 EUR	State of Rhineland-Palatinate, 0.010%, 25/02/28	399 888	0,01	
200 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.250%, 13/03/26	209 819	0,00	200 000 EUR	State of Rhineland-Palatinate, 0.010%, 21/01/31	185 902	0,00	
100 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.500%, 16/04/26	105 278	0,00	500 000 EUR	State of Rhineland-Palatinate, 0.750%, 23/02/32	480 423	0,01	
300 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.500%, 16/02/27	311 491	0,00	400 000 EUR	State of Saxony-Anhalt, 0.010%, 01/04/25	425 560	0,01	
400 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.200%, 31/03/27	410 559	0,01	200 000 EUR	State of Saxony-Anhalt, 0.750%, 29/01/29	203 143	0,00	
500 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 3.000%, 27/01/28	564 040	0,01	400 000 EUR	State of Saxony-Anhalt, 0.010%, 10/03/31	369 748	0,01	
200 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.950%, 13/03/28	207 838	0,00	400 000 EUR	State of Schleswig-Holstein Germany, 0.010%, 16/07/25	423 258	0,01	
300 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.900%, 15/11/28	308 141	0,00	200 000 EUR	State of Schleswig-Holstein Germany, 0.250%, 27/02/26	209 910	0,00	
500 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.010%, 15/01/29	488 482	0,01	500 000 EUR	State of Schleswig-Holstein Germany, 1.375%, 14/07/27	532 055	0,01	
500 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.200%, 09/04/30	480 423	0,01	100 000 EUR	State of Schleswig-Holstein Germany, 3.000%, 05/06/30	113 863	0,00	
500 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.125%, 04/06/31	464 356	0,01	150 000 EUR	State of Schleswig-Holstein Germany, 0.200%, 15/08/39	110 374	0,00	
1 000 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 2.750%, 15/01/32	1 120 380	0,02	Allemagne – Total			189 188 412	2,83
250 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 1.100%, 13/03/34	238 395	0,00	Hong Kong				
500 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.010%, 12/10/35	400 894	0,01	500 000 USD	Airport Authority, 4.875%, 12/01/26	502 640	0,01	
200 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 1.650%, 22/02/38	190 097	0,00	500 000 USD	Airport Authority, 2.625%, 04/02/51	343 980	0,00	
400 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 1.500%, 12/06/40	359 908	0,01	500 000 USD	Airport Authority, 3.250%, 12/01/52	385 395	0,01	
400 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 1.650%, 16/05/47	342 804	0,01	500 000 USD	Hong Kong Government International Bond, 0.625%, 02/02/26	463 790	0,01	
200 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 1.550%, 16/06/48	165 795	0,00	Hong-Kong – Total			1 695 805	0,03
200 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.800%, 30/07/49	133 888	0,00	Hongrie				
300 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.200%, 27/01/51	158 914	0,00	40 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 5.500%, 24/06/25	114 272	0,00	
400 000 EUR	State of North Rhine-Westphalia Germany, 0.500%, 15/01/52	231 641	0,00	100 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.000%, 26/11/25	262 776	0,01	
				50 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.500%, 22/04/26	130 297	0,00	

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Hongrie (suite)				Indonésie			
50 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.500%, 26/08/26	128 889	0,00	200 000 EUR	Indonesia Government International Bond, 1.750%, 24/04/25	214 379	0,00
40 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.750%, 22/12/26	105 194	0,00	100 000 EUR	Indonesia Government International Bond, 3.375%, 30/07/25	109 661	0,00
92 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 27/10/27	243 410	0,00	200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.350%, 08/01/27	198 868	0,00
15 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 6.750%, 22/10/28	45 022	0,00	500 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.550%, 11/01/28	499 690	0,01
50 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.000%, 23/05/29	120 572	0,00	200 000 EUR	Indonesia Government International Bond, 3.750%, 14/06/28	222 366	0,00
100 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 21/08/30	247 476	0,01	300 000 USD	Indonesia Government International Bond, 2.850%, 14/02/30	271 764	0,00
220 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.250%, 22/10/31	540 524	0,01	500 000 USD	Indonesia Government International Bond, 1.850%, 12/03/31	416 395	0,01
500 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 4.750%, 24/11/32	1 331 901	0,02	300 000 USD	Indonesia Government International Bond, 2.150%, 28/07/31	253 359	0,00
100 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.250%, 20/04/33	218 436	0,00	300 000 EUR	Indonesia Government International Bond, 1.400%, 30/10/31	280 181	0,00
50 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 27/10/38	101 125	0,00	500 000 USD	Indonesia Government International Bond, 3.550%, 31/03/32	462 335	0,01
75 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 25/04/41	146 157	0,00	250 000 USD	Indonesia Government International Bond, 8.500%, 12/10/35	332 675	0,01
200 000 EUR	Hungary Government International Bond, 1.750%, 10/10/27	206 855	0,00	100 000 USD	Indonesia Government International Bond, 6.625%, 17/02/37	117 271	0,00
500 000 USD	Hungary Government International Bond, 6.125%, 22/05/28	520 285	0,01	200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.625%, 15/04/43	196 218	0,00
400 000 EUR	Hungary Government International Bond, 0.125%, 21/09/28	369 704	0,01	200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 6.750%, 15/01/44	245 428	0,00
500 000 EUR	Hungary Government International Bond, 4.250%, 16/06/31	553 126	0,01	100 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.750%, 18/07/47	98 401	0,00
500 000 USD	Hungary Government International Bond, 2.125%, 22/09/31	403 035	0,01	500 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.350%, 11/01/48	463 325	0,01
500 000 USD	Hungary Government International Bond, 6.250%, 22/09/32	533 880	0,01	300 000 USD	Indonesia Government International Bond, 3.700%, 30/10/49	251 202	0,00
100 000 USD	Hungary Government International Bond, 7.625%, 29/03/41	119 685	0,00	300 000 USD	Indonesia Government International Bond, 3.500%, 14/02/50	241 413	0,00
300 000 EUR	Hungary Government International Bond, 1.500%, 17/11/50	193 697	0,00	500 000 USD	Indonesia Government International Bond, 5.650%, 11/01/53	548 280	0,01
500 000 USD	Hungary Government International Bond, 6.750%, 25/09/52	558 915	0,01	27 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.500%, 15/06/25	1 754 150	0,03
Hongrie – Total		7 195 233	0,11				
Islande							
300 000 EUR	Iceland Government International Bond, 0.625%, 03/06/26	311 415	0,00				
Islande – Total		311 415	0,00				
Inde							
300 000 USD	Export-Import Bank of India, 3.875%, 01/02/28	288 345	0,01				
300 000 USD	Export-Import Bank of India, 3.250%, 15/01/30	273 513	0,00				
500 000 USD	Export-Import Bank of India, 2.250%, 13/01/31	418 815	0,01				
Inde – Total		980 673	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)				
Indonésie (suite)				Irlande (suite)				
30 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 5.500%, 15/04/26	1 913 184	0,03	1 250 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.010%, 18/10/31	1 158 681	0,02	
16 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 15/09/26	1 089 989	0,02	250 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.350%, 18/10/32	232 813	0,00	
40 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 5.125%, 15/04/27	2 506 644	0,04	300 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.300%, 15/05/33	301 424	0,00	
19 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/05/27	1 254 985	0,02	600 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.400%, 15/05/35	526 361	0,01	
27 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.125%, 15/05/28	1 732 054	0,03	375 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.700%, 15/05/37	369 609	0,01	
21 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/09/30	1 395 926	0,02	500 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.550%, 22/04/41	387 047	0,01	
38 500 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.500%, 15/02/31	2 494 811	0,04	1 000 000 EUR	Ireland Government Bond, 3.000%, 18/10/43	1 146 428	0,02	
8 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/08/32	550 133	0,01	700 000 EUR	Ireland Government Bond, 2.000%, 18/02/45	669 160	0,01	
54 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/06/35	3 749 032	0,06	1 150 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.500%, 15/05/50	958 325	0,01	
11 600 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.250%, 15/05/36	850 137	0,01	Irlande – Total			13 758 917	0,21
37 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/05/38	2 572 121	0,04	Ile de Man				
21 200 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 15/04/39	1 583 825	0,02	300 000 GBP	Isle of Man Government International Bond, 1.625%, 14/09/51	199 224	0,00	
20 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/04/40	1 387 855	0,02	Ile de Man – Total			199 224	0,00
52 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.125%, 15/06/42	3 501 768	0,05	Israël				
500 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 1.500%, perpetual	463 415	0,01	2 000 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 0.500%, 30/04/25	531 506	0,01	
200 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.325%, 28/05/25	198 910	0,00	1 800 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.750%, 31/08/25	483 449	0,01	
100 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.150%, 29/03/27	99 025	0,00	1 000 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 6.250%, 30/10/26	296 898	0,01	
500 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 5.400%, 15/11/28	515 920	0,01	1 800 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 2.000%, 31/03/27	474 956	0,01	
400 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.450%, 20/02/29	399 432	0,01	2 000 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 2.250%, 28/09/28	521 725	0,01	
Indonésie – Total			35 436 527	0,53	1 500 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.000%, 31/03/30	352 670	0,01
Irlande				3 500 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.300%, 30/04/32	791 502	0,01	
667 000 EUR	Ireland Government Bond, 5.400%, 13/03/25	757 616	0,01	1 400 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.500%, 31/05/37	278 943	0,00	
1 050 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.000%, 15/05/26	1 126 443	0,02	1 650 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 5.500%, 31/01/42	520 092	0,01	
1 000 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.200%, 15/05/27	1 035 157	0,02	3 000 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 3.750%, 31/03/47	737 649	0,01	
900 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.900%, 15/05/28	944 307	0,01	200 000 USD	Israel Government International Bond, 2.875%, 16/03/26	190 742	0,00	
1 400 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.100%, 15/05/29	1 463 772	0,02	300 000 EUR	Israel Government International Bond, 1.500%, 18/01/27	307 190	0,01	
550 000 EUR	Ireland Government Bond, 2.400%, 15/05/30	613 998	0,01	500 000 USD	Israel Government International Bond, 6.500%, 06/11/31	538 525	0,01	
1 500 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.200%, 18/10/30	1 444 336	0,02	300 000 EUR	Israel Government International Bond, 0.625%, 18/01/32	255 764	0,00	
600 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.350%, 18/03/31	623 440	0,01	1 000 000 USD	Israel Government International Bond, 4.500%, 17/01/33	950 290	0,01	
				300 000 USD	Israel Government International Bond, 4.125%, 17/01/48	242 304	0,00	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Israël (suite)				Italie (suite)			
300 000 EUR	Israel Government International Bond, 2.500%, 16/01/49	249 325	0,00	1 650 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.850%, 15/01/27	1 721 296	0,03
300 000 USD	State of Israel, 2.500%, 15/01/30	261 444	0,00	3 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.100%, 01/04/27	3 665 190	0,06
300 000 USD	State of Israel, 3.375%, 15/01/50	212 670	0,00	1 325 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.200%, 01/06/27	1 435 544	0,02
500 000 USD	State of Israel, 3.800%, 13/05/60	357 865	0,01	1 550 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.050%, 01/08/27	1 667 930	0,03
Israël – Total		8 555 509	0,13	2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 15/09/27	2 064 967	0,03
Italie				2 133 024 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.500%, 01/11/27	2 665 385	0,04
200 000 EUR	Cassa Depositi e Prestiti SpA, 1.500%, 09/04/25	215 678	0,00	2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.650%, 01/12/27	2 192 267	0,03
400 000 EUR	Cassa Depositi e Prestiti SpA, 0.750%, 30/06/29	382 496	0,01	1 900 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.000%, 01/02/28	2 029 301	0,03
1 600 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 01/12/24	1 754 679	0,03	1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.250%, 15/03/28	1 485 478	0,02
1 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 15/12/24	1 928 480	0,03	1 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.400%, 01/04/28	2 025 652	0,03
2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.350%, 01/02/25	2 142 601	0,03	1 200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.500%, 15/07/28	1 190 185	0,02
2 550 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/03/25	2 874 378	0,04	1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.800%, 01/08/28	1 714 091	0,03
1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.400%, 28/03/25	1 661 482	0,03	1 925 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.750%, 01/09/28	2 290 316	0,03
1 900 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.450%, 15/05/25	2 054 718	0,03	2 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 01/12/28	2 741 245	0,04
2 200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.500%, 01/06/25	2 378 904	0,04	3 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.100%, 01/02/29	3 475 638	0,05
1 900 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.850%, 01/07/25	2 063 176	0,03	1 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.450%, 15/02/29	970 932	0,01
1 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.200%, 15/08/25	1 933 332	0,03	3 200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 15/06/29	3 483 837	0,05
1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.600%, 29/09/25	1 674 357	0,03	1 900 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.000%, 01/08/29	2 090 923	0,03
1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 15/11/25	1 646 586	0,02	2 100 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.500%, 15/01/26	2 349 760	0,04
1 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.000%, 01/12/25	1 957 133	0,03	1 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.500%, 01/02/26	1 894 877	0,03
2 100 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.500%, 15/01/26	2 349 760	0,04	2 350 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.500%, 01/03/26	2 686 084	0,04
1 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.500%, 01/02/26	1 894 877	0,03	2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/04/26	2 074 754	0,03
2 350 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.500%, 01/03/26	2 686 084	0,04	2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.800%, 15/04/26	2 257 485	0,03
2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/04/26	2 074 754	0,03	3 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.600%, 01/06/26	3 546 265	0,05
2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.800%, 15/04/26	2 257 485	0,03	1 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.100%, 15/07/26	1 521 209	0,02
3 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.600%, 01/06/26	3 546 265	0,05	3 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/08/26	3 395 749	0,05
1 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.100%, 15/07/26	1 521 209	0,02	5 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 15/09/26	6 238 644	0,09
3 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/08/26	3 395 749	0,05	1 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 7.250%, 01/11/26	1 609 175	0,02
5 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 15/09/26	6 238 644	0,09	1 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.250%, 01/12/26	1 375 860	0,02
1 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 7.250%, 01/11/26	1 609 175	0,02	2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 30/10/31	2 302 356	0,03
1 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.250%, 01/12/26	1 375 860	0,02				

Tableau des investissements (*suite*) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Obligations d'État – 63,42 % (<i>suite</i>)				Obligations d'État – 63,42 % (<i>suite</i>)			
Italie (<i>suite</i>)				Italie (<i>suite</i>)			
2 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/12/31	2 296 844	0,03	1 850 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.450%, 01/09/50	1 494 507	0,02
1 900 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.650%, 01/03/32	1 835 494	0,03	1 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.700%, 01/09/51	949 341	0,01
2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/06/32	1 809 373	0,03	950 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.150%, 01/09/52	698 419	0,01
1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 01/12/32	1 529 985	0,02	1 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.500%, 01/10/53	1 477 116	0,02
1 200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.750%, 01/02/33	1 548 119	0,02	950 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 01/03/67	768 572	0,01
2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.400%, 01/05/33	2 354 473	0,04	1 750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.150%, 01/03/72	1 179 891	0,02
1 600 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.450%, 01/09/33	1 604 482	0,02	1 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.700%, perpetual	1 700 007	0,03
2 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.350%, 01/11/33	2 924 755	0,04	300 000 USD	Republic of Italy Government International Bond, 1.250%, 17/02/26	277 434	0,00
2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.200%, 01/03/34	2 307 548	0,03	200 000 USD	Republic of Italy Government International Bond, 2.875%, 17/10/29	179 352	0,00
1 578 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/08/34	1 940 810	0,03	50 000 USD	Republic of Italy Government International Bond, 5.375%, 15/06/33	50 353	0,00
1 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.350%, 01/03/35	1 912 295	0,03	300 000 USD	Republic of Italy Government International Bond, 4.000%, 17/10/49	225 609	0,00
1 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 30/04/35	2 030 842	0,03	500 000 USD	Republic of Italy Government International Bond, 3.875%, 06/05/51	359 165	0,01
2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.450%, 01/03/36	1 700 388	0,03				
1 750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.250%, 01/09/36	1 620 569	0,02				
2 241 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 01/02/37	2 506 094	0,04	Italie – Total		181 735 152	2,72
3 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/03/37	2 322 416	0,04	Japon			
1 200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.250%, 01/03/38	1 217 373	0,02	200 000 EUR	Development Bank of Japan Inc, 0.875%, 10/10/25	212 753	0,00
1 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.950%, 01/09/38	1 370 966	0,02	133 000 GBP	Development Bank of Japan Inc, 5.250%, 30/03/26	172 073	0,00
1 461 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/08/39	1 782 530	0,03	100 000 USD	Development Bank of Japan Inc, 2.625%, 01/09/27	94 162	0,00
1 250 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.100%, 01/03/40	1 223 041	0,02	200 000 EUR	Development Bank of Japan Inc, 4.750%, 26/11/27	237 354	0,00
1 827 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/09/40	2 229 844	0,03	500 000 USD	Development Bank of Japan Inc, 1.250%, 28/01/31	406 250	0,01
2 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.800%, 01/03/41	1 832 375	0,03	500 000 USD	Development Bank of Japan Inc, 1.750%, perpetual	415 760	0,01
2 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.450%, 01/09/43	2 848 451	0,04	200 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 2.500%, 28/05/25	193 626	0,00
1 750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.750%, 01/09/44	2 079 283	0,03	300 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 0.625%, 15/07/25	281 658	0,00
1 200 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.500%, 30/04/45	838 456	0,01	500 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 3.875%, 16/09/25	492 740	0,01
1 700 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.250%, 01/09/46	1 627 299	0,02	1 000 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 4.250%, 26/01/26	994 490	0,02
2 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.700%, 01/03/47	2 002 678	0,03	1 000 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 4.250%, 27/04/26	993 740	0,01
1 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.450%, 01/03/48	986 894	0,02	100 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 2.875%, 01/06/27	95 337	0,00
1 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 01/09/49	1 200 161	0,02	200 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 2.875%, 21/07/27	190 492	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
1 000 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 4.625%, 19/07/28	1 013 950	0,02	56 500 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.400%, 20/03/48	469 790	0,01
300 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 3.250%, 20/07/28	286 941	0,00	70 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.200%, 20/03/49	559 970	0,01
500 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 1.250%, 21/01/31	406 380	0,01	84 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.200%, 20/03/50	672 006	0,01
500 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 2.875%, perpetual	487 615	0,01	190 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.200%, 20/03/51	1 517 951	0,02
500 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 4.375%, perpetual	501 200	0,01	226 900 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 2.000%, 20/03/52	1 740 731	0,03
1 500 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 2.125%, perpetual	1 347 300	0,02	221 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.900%, 20/03/53	1 658 613	0,02
500 000 USD	Japan Bank for International Cooperation, 1.875%, perpetual	422 475	0,01	202 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.700%, 20/03/54	1 445 938	0,02
200 000 USD	Japan Finance Organization for Municipalities, 2.375%, 13/02/25	194 086	0,00	263 500 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.400%, 20/03/55	1 746 187	0,03
660 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/03/25	4 688 725	0,07	400 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.400%, 20/03/56	1 940 133	0,03
950 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/06/25	6 750 472	0,10	355 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.900%, 20/03/57	2 016 233	0,03
1 040 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/09/25	7 388 957	0,11	250 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.800%, 20/03/58	1 363 828	0,02
880 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/12/25	6 252 569	0,09	315 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.500%, 20/03/59	1 528 838	0,02
830 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/03/26	5 884 475	0,09	600 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.500%, 20/03/60	2 882 622	0,04
1 000 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/06/26	7 088 736	0,11	560 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 0.700%, 20/03/61	2 866 375	0,04
1 000 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/09/26	7 085 970	0,11	460 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.000%, 20/03/62	2 589 939	0,04
850 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/12/26	6 019 155	0,09	230 000 000 JPY	Japan Government Forty Year Bond, 1.300%, 20/03/63	1 416 251	0,02
850 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/03/27	6 016 804	0,09	270 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.500%, 20/12/24	1 925 431	0,03
950 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/03/27	6 745 418	0,10	742 500 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/03/25	5 294 829	0,08
950 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/06/27	6 718 329	0,10	875 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/06/25	6 244 849	0,09
780 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/09/27	5 532 368	0,08	900 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/09/25	6 427 614	0,10
500 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.200%, 20/12/27	3 555 646	0,05	750 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.300%, 20/12/25	5 349 748	0,08
900 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.300%, 20/12/27	6 425 890	0,10	765 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/26	5 435 906	0,08
700 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/03/28	4 952 383	0,07	730 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/26	5 187 619	0,08
500 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.200%, 20/03/28	3 552 277	0,05	840 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/26	5 968 183	0,09
200 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/06/28	1 413 747	0,02	760 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/26	5 398 976	0,08
500 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.200%, 20/06/28	3 549 582	0,05	890 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/27	6 319 391	0,09
200 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.300%, 20/06/28	1 425 961	0,02	840 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/27	5 961 748	0,09
350 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.300%, 20/09/28	2 492 378	0,04	755 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/27	5 353 816	0,08
350 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.400%, 20/09/28	2 503 923	0,04	790 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/27	5 599 989	0,08

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
1 005 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/28	7 116 695	0,11	58 900 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/05/32	479 685	0,01
690 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/28	4 879 579	0,07	71 900 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.800%, 22/11/32	565 357	0,01
900 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/28	6 350 624	0,10	200 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/12/32	1 523 365	0,02
795 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/28	5 605 376	0,08	300 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.100%, 20/03/33	2 233 742	0,03
690 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/29	4 860 492	0,07	70 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/06/33	546 857	0,01
860 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/29	6 055 259	0,09	30 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.100%, 20/09/33	243 134	0,00
710 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/29	4 994 274	0,07	55 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.000%, 20/12/33	441 205	0,01
945 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/29	6 640 807	0,10	141 700 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/03/34	1 176 870	0,02
970 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/30	6 815 664	0,10	89 750 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/06/34	753 765	0,01
910 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/30	6 382 522	0,10	51 250 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/09/34	430 605	0,01
930 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/30	6 497 005	0,10	70 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/12/34	583 361	0,01
880 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/30	6 131 349	0,09	165 550 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/03/35	1 368 400	0,02
730 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/31	5 071 786	0,08	68 700 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/06/35	568 161	0,01
855 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/31	5 923 080	0,09	150 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/09/35	1 266 584	0,02
750 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/31	5 180 788	0,08	180 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/12/35	1 490 458	0,02
950 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/31	6 543 396	0,10	68 950 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/03/36	582 681	0,01
970 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.200%, 20/03/32	6 727 526	0,10	80 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/06/36	676 533	0,01
950 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.200%, 20/06/32	6 563 814	0,10	104 100 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/09/36	880 767	0,01
950 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.200%, 20/09/32	6 555 997	0,10	105 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/12/36	871 050	0,01
1 000 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.500%, 20/12/32	7 060 221	0,11	108 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/03/37	905 490	0,01
950 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.500%, 20/03/33	6 691 577	0,10	90 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/09/37	762 874	0,01
1 100 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/06/33	7 660 285	0,11	121 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.500%, 20/03/38	1 025 599	0,02
400 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.800%, 20/09/33	2 885 799	0,04	253 150 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/09/38	2 130 622	0,03
28 600 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.800%, 20/09/29	232 210	0,00	235 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/03/39	1 944 926	0,03
50 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/02/30	400 585	0,01	280 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.200%, 20/09/39	2 287 488	0,03
230 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/05/30	1 839 070	0,03	280 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/03/40	2 313 704	0,03
80 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.900%, 20/11/30	666 449	0,01	560 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.000%, 20/09/40	4 437 776	0,07
50 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.200%, 20/05/31	400 950	0,01	278 800 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.200%, 20/03/41	2 265 482	0,03
120 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/11/31	978 752	0,01	415 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.000%, 20/09/41	3 273 725	0,05

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
360 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.000%, 20/03/42	2 838 173	0,04	155 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.400%, 20/12/49	823 695	0,01
415 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.900%, 20/09/42	3 217 884	0,05	245 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.400%, 20/03/50	1 293 297	0,02
260 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.800%, 20/03/43	1 979 913	0,03	270 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.600%, 20/06/50	1 499 919	0,02
255 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.900%, 20/06/43	1 969 295	0,03	210 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.600%, 20/09/50	1 163 163	0,02
432 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.800%, 20/09/43	3 280 295	0,05	275 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/12/50	1 561 753	0,02
195 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/12/43	1 457 258	0,02	245 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/03/51	1 386 775	0,02
285 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/03/44	2 126 644	0,03	250 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/06/51	1 410 289	0,02
210 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/06/44	1 563 054	0,02	305 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/09/51	1 716 096	0,03
220 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.700%, 20/09/44	1 635 940	0,02	270 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/12/51	1 516 639	0,02
235 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.500%, 20/12/44	1 685 222	0,03	300 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.000%, 20/03/52	1 823 514	0,03
280 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.500%, 20/03/45	2 004 548	0,03	360 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.300%, 20/06/52	2 355 934	0,04
280 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.600%, 20/06/45	2 037 041	0,03	290 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/09/52	1 942 165	0,03
275 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/09/45	1 931 574	0,03	350 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.600%, 20/12/52	2 453 277	0,04
220 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/12/45	1 538 174	0,02	275 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.400%, 20/03/53	1 837 787	0,03
210 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/03/46	1 298 327	0,02	300 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.200%, 20/06/53	1 904 802	0,03
225 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.300%, 20/06/46	1 235 776	0,02	250 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 1.800%, 20/09/53	1 831 643	0,03
230 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.500%, 20/09/46	1 318 756	0,02	82 550 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/12/24	597 255	0,01
395 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.600%, 20/12/46	2 310 910	0,03	50 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/24	362 119	0,01
285 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/03/47	1 739 899	0,03	85 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/03/25	617 182	0,01
170 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/06/47	1 034 989	0,02	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/03/25	1 453 937	0,02
220 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/09/47	1 336 994	0,02	80 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/25	582 159	0,01
185 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/12/47	1 119 553	0,02	180 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/06/25	1 315 392	0,02
285 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.800%, 20/03/48	1 719 218	0,03	80 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/06/25	584 270	0,01
200 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/06/48	1 174 152	0,02	150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/25	1 096 847	0,02
580 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.900%, 20/09/48	3 561 253	0,05	80 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/09/25	587 022	0,01
190 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.700%, 20/12/48	1 106 226	0,02	495 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/25	3 636 730	0,05
265 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.500%, 20/03/49	1 459 305	0,02	182 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/12/25	1 342 422	0,02
155 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.400%, 20/06/49	827 158	0,01	52 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/25	386 938	0,01
300 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 0.400%, 20/09/49	1 594 524	0,02	116 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/26	864 823	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
100 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/26	743 666	0,01	190 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/12/29	1 502 520	0,02
190 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/03/26	1 415 485	0,02	365 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/30	2 882 200	0,04
250 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/06/26	1 868 049	0,03	244 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/30	1 942 343	0,03
179 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/06/26	1 342 284	0,02	207 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/06/30	1 597 754	0,02
180 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/09/26	1 351 353	0,02	145 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/06/30	1 127 448	0,02
120 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/09/26	903 149	0,01	270 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/06/30	2 125 240	0,03
382 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/26	2 880 294	0,04	130 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/09/30	1 012 355	0,02
237 500 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/03/27	1 789 319	0,03	340 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/09/30	2 663 446	0,04
181 250 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/27	1 370 200	0,02	182 300 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/12/30	1 439 133	0,02
100 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/27	758 611	0,01	300 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/30	2 385 615	0,04
240 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/06/27	1 832 447	0,03	120 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/03/31	942 619	0,01
108 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/27	829 372	0,01	192 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/03/31	1 518 827	0,02
140 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/09/27	1 069 930	0,02	290 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/31	2 323 168	0,03
285 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/27	2 178 578	0,03	110 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/06/31	859 511	0,01
205 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/28	1 579 944	0,02	323 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/06/31	2 544 454	0,04
275 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.400%, 20/03/28	2 133 737	0,03	150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/09/31	1 165 112	0,02
160 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/28	1 231 789	0,02	265 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/09/31	2 074 850	0,03
146 300 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/06/28	1 135 491	0,02	222 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/12/31	1 726 177	0,03
123 850 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.400%, 20/06/28	965 148	0,01	510 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/12/31	3 993 758	0,06
324 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/28	2 508 146	0,04	147 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/03/32	1 135 814	0,02
88 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/09/28	687 780	0,01	120 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/03/32	933 928	0,01
184 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/12/28	1 422 030	0,02	248 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/03/32	1 948 941	0,03
100 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/28	774 975	0,01	350 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/06/32	2 687 165	0,04
120 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/03/29	924 633	0,01	120 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/06/32	928 974	0,01
265 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/29	2 061 165	0,03	150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/06/32	1 170 772	0,02
210 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/29	1 640 020	0,02	410 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/09/32	3 199 530	0,05
150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/06/29	1 177 146	0,02	320 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/12/32	2 496 853	0,04
370 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/29	2 900 398	0,04	215 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/12/32	1 690 796	0,03
200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/29	1 572 847	0,02	280 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/03/33	2 154 757	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
417 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/03/33	3 229 103	0,05	350 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/06/40	2 186 991	0,03
335 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/06/33	2 617 838	0,04	340 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/09/40	2 113 677	0,03
420 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/09/33	3 282 393	0,05	530 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/12/40	3 336 504	0,05
500 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/12/33	3 874 131	0,06	380 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/03/41	2 379 515	0,04
270 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/03/34	2 076 997	0,03	395 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/06/41	2 419 872	0,04
435 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/06/34	3 346 612	0,05	440 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/09/41	2 733 755	0,04
425 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.400%, 20/09/34	3 226 841	0,05	450 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/12/41	2 783 469	0,04
420 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.200%, 20/12/34	3 128 967	0,05	570 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.800%, 20/03/42	3 709 367	0,06
610 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.200%, 20/03/35	4 532 813	0,07	600 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.900%, 20/06/42	3 960 689	0,06
380 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.300%, 20/06/35	2 854 178	0,04	550 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.100%, 20/09/42	3 748 879	0,06
322 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.200%, 20/09/35	2 391 086	0,04	520 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.400%, 20/12/42	3 718 085	0,06
430 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.000%, 20/12/35	3 110 561	0,05	930 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.100%, 20/03/43	6 303 986	0,09
455 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/03/36	3 070 879	0,05	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.100%, 20/06/43	1 351 936	0,02
445 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.200%, 20/06/36	2 906 957	0,04	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/09/43	1 445 042	0,02
540 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/09/36	3 664 133	0,05	250 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/01/25	1 774 206	0,03
555 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.600%, 20/12/36	3 787 960	0,06	250 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/02/25	1 774 330	0,03
240 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.700%, 20/03/37	1 653 409	0,02	650 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/03/25	4 612 520	0,07
340 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.600%, 20/06/37	2 308 300	0,03	450 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/04/25	3 194 272	0,05
240 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.600%, 20/09/37	1 619 974	0,02	250 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/05/25	1 774 844	0,03
290 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.600%, 20/12/37	1 952 656	0,03	500 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/06/25	3 547 986	0,05
385 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/03/38	2 543 654	0,04	300 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/08/25	2 128 727	0,03
330 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/06/38	2 172 036	0,03	300 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/09/25	2 127 898	0,03
350 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.700%, 20/09/38	2 362 066	0,04	200 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/10/25	1 418 343	0,02
345 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.500%, 20/12/38	2 251 554	0,03	Japon – Total		725 086 795	10,86
280 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/03/39	1 791 519	0,03	Kazakhstan			
285 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.300%, 20/06/39	1 786 961	0,03	300 000 EUR	Kazakhstan Government International Bond, 1.500%, 30/09/34	264 748	0,00
310 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.300%, 20/09/39	1 933 905	0,03	300 000 USD	Kazakhstan Government International Bond, 4.875%, 14/10/44	289 110	0,01
315 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.300%, 20/12/39	1 955 869	0,03	Kazakhstan – Total		553 858	0,01
275 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 0.400%, 20/03/40	1 726 757	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Corée				Corée (suite)			
500 000 USD	Export-Import Bank of Korea, 1.250%, 18/01/25	481 975	0,01	200 000 USD	Korea National Oil Corp, 3.375%, 27/03/27	192 052	0,00
400 000 EUR	Export-Import Bank of Korea, 0.829%, 27/04/25	426 952	0,01	8 900 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.875%, 10/12/24	6 817 754	0,10
1 000 000 USD	Export-Import Bank of Korea, 5.375%, 18/09/25	1 010 480	0,01	4 800 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/03/25	3 647 166	0,05
500 000 USD	Export-Import Bank of Korea, 0.750%, 21/09/25	467 090	0,01	4 700 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.125%, 10/09/25	3 520 898	0,05
400 000 EUR	Export-Import Bank of Korea, 1.375%, 24/11/25	427 831	0,01	3 300 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.250%, 10/12/25	2 514 795	0,04
100 000 USD	Export-Import Bank of Korea, 2.375%, 21/04/27	93 498	0,00	4 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.250%, 10/03/26	2 976 637	0,04
500 000 USD	Export-Import Bank of Korea, 5.000%, 11/01/28	509 685	0,01	6 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.875%, 10/06/26	4 512 791	0,07
1 000 000 USD	Export-Import Bank of Korea, 5.125%, 18/09/28	1 027 380	0,02	2 075 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/12/26	1 534 675	0,02
500 000 USD	Export-Import Bank of Korea, 1.750%, 19/10/28	442 390	0,01	2 600 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.125%, 10/06/27	1 948 697	0,03
500 000 USD	Export-Import Bank of Korea, 5.125%, 11/01/33	519 550	0,01	4 600 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.375%, 10/12/27	3 465 490	0,05
500 000 USD	Export-Import Bank of Korea, 2.500%, perpetual	366 380	0,01	4 700 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.250%, 10/03/28	3 657 032	0,05
500 000 USD	Korea Development Bank, 1.250%, 03/06/25	475 720	0,01	1 740 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 5.500%, 10/12/29	1 519 053	0,02
500 000 USD	Korea Development Bank, 4.000%, 08/09/25	493 565	0,01	5 500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.375%, 10/06/30	3 819 990	0,06
200 000 USD	Korea Development Bank, 2.000%, 12/09/26	186 280	0,00	5 300 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/12/30	3 682 033	0,05
500 000 USD	Korea Development Bank, 4.375%, 15/02/28	499 110	0,01	3 100 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.000%, 10/06/31	2 216 649	0,03
500 000 USD	Korea Development Bank, 4.375%, 15/02/33	492 035	0,01	1 400 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 4.000%, 10/12/31	1 146 887	0,02
500 000 USD	Korea Development Bank, 0.750%, perpetual	478 920	0,01	6 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 4.250%, 10/12/32	5 028 136	0,07
500 000 USD	Korea Development Bank, 1.375%, perpetual	452 175	0,01	900 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.750%, 10/12/33	731 625	0,01
500 000 USD	Korea Development Bank, 2.000%, perpetual	416 400	0,01	800 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.625%, 10/09/35	587 668	0,01
100 000 USD	Korea Gas Corp, 3.125%, 20/07/27	95 179	0,00	1 590 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/09/36	1 019 300	0,01
200 000 EUR	Korea Housing Finance Corp, 0.010%, 05/02/25	212 276	0,00	1 480 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.250%, 10/09/37	1 032 633	0,02
400 000 EUR	Korea Housing Finance Corp, 0.723%, 22/03/25	426 757	0,01	2 700 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.125%, 10/09/39	1 565 435	0,02
100 000 EUR	Korea Housing Finance Corp, 0.258%, perpetual	97 013	0,00	2 750 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/09/40	1 674 676	0,02
500 000 EUR	Korea International Bond, 0.010%, 15/10/26	508 106	0,01	5 100 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.250%, 10/09/42	4 020 042	0,06
100 000 USD	Korea International Bond, 2.750%, 19/01/27	95 836	0,00	850 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.000%, 10/12/42	645 667	0,01
200 000 USD	Korea International Bond, 2.500%, 19/06/29	184 392	0,00	1 300 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.750%, 10/12/44	955 261	0,01
800 000 USD	Korea International Bond, 1.750%, perpetual	672 224	0,01	1 400 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.000%, 10/03/46	894 653	0,01
500 000 USD	Korea National Oil Corp, 1.750%, 18/04/25	479 940	0,01	1 137 500 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.125%, 10/03/47	741 759	0,01
500 000 USD	Korea National Oil Corp, 4.750%, 03/04/26	498 410	0,01	3 400 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.625%, 10/03/48	2 426 885	0,04

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Corée (suite)				Malaisie			
6 800 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/03/50	3 787 847	0,06	500 000 USD	Export-Import Bank of Malaysia Bhd, 1.831%, 26/11/26	457 725	0,01
6 900 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.875%, 10/03/51	4 188 239	0,06	700 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.882%, 14/03/25	153 324	0,00
4 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.250%, 10/03/53	3 229 418	0,05	5 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.955%, 15/09/25	1 098 629	0,02
1 500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.625%, 10/09/53	1 287 558	0,02	4 800 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.900%, 30/11/26	1 056 992	0,02
Corée – Total		93 526 950	1,40	6 600 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.899%, 16/11/27	1 453 939	0,02
Koweït				7 500 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.885%, 15/08/29	1 648 417	0,02
300 000 USD	Kuwait International Government Bond, 3.500%, 20/03/27	293 079	0,00	6 600 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.254%, 31/05/35	1 477 710	0,02
Koweït – Total		293 079	0,00	7 550 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.762%, 07/04/37	1 772 697	0,03
Lettonie				11 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.757%, 22/05/40	2 292 788	0,03
200 000 EUR	Latvia Government International Bond, 1.125%, 30/05/28	204 780	0,00	3 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.736%, 15/03/46	699 858	0,01
200 000 EUR	Latvia Government International Bond, 1.875%, 19/02/49	159 863	0,00	6 300 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.065%, 15/06/50	1 335 943	0,02
500 000 EUR	Latvia Government International Bond, 0.010%, perpetual	442 003	0,01	5 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.457%, 31/03/53	1 127 182	0,02
Lettonie – Total		806 646	0,01	12 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.726%, 31/03/26	2 735 528	0,04
Lituanie				6 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.130%, 09/07/29	1 333 502	0,02
100 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 2.125%, 29/10/26	107 939	0,00	6 900 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.119%, 30/11/34	1 534 443	0,02
200 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 0.950%, 26/05/27	205 480	0,01	2 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.447%, 15/07/36	413 258	0,01
150 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 1.625%, 19/06/49	110 499	0,00	4 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.291%, 14/08/43	1 003 309	0,01
200 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 0.500%, 28/07/50	110 427	0,00	Malaisie – Total		21 595 244	0,32
500 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 2.125%, perpetual	507 725	0,01	Mexique			
Lituanie – Total		1 042 070	0,02	14 000 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 05/12/24	822 705	0,01
Luxembourg				35 000 000 MXN	Mexican Bonos, 5.750%, 05/03/26	1 905 536	0,03
500 000 EUR	European Financial Stability Facility, 2.750%, 17/08/26	555 733	0,01	15 000 000 MXN	Mexican Bonos, 5.500%, 04/03/27	793 310	0,01
500 000 EUR	European Financial Stability Facility, 3.000%, 10/07/30	568 066	0,01	35 000 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 03/06/27	1 960 988	0,03
1 000 000 EUR	European Financial Stability Facility, 2.875%, 16/02/33	1 127 472	0,02	25 200 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 31/05/29	1 461 479	0,02
500 000 EUR	European Financial Stability Facility, 3.375%, 30/08/38	577 621	0,01	29 500 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 29/05/31	1 631 110	0,02
400 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 0.010%, 28/04/25	425 189	0,00	100 000 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 26/05/33	5 372 110	0,08
300 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 0.625%, 01/02/27	313 765	0,00	7 500 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 23/11/34	406 854	0,01
100 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 2.250%, 19/03/28	110 127	0,00	40 000 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 24/05/35	2 171 614	0,03
500 000 EUR	State of the Grand-Duchy of Luxembourg, 3.000%, 02/03/33	578 196	0,01	6 000 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 20/11/36	383 820	0,01
Luxembourg – Total		4 256 169	0,06	21 000 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 18/11/38	1 189 366	0,02
				14 300 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 13/11/42	746 637	0,01
				37 000 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 07/11/47	1 964 871	0,03
				15 000 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 31/07/53	792 149	0,01
				100 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.125%, 21/01/26	99 164	0,00
				500 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.150%, 28/03/27	495 875	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Mexique (suite)				Pays-Bas (suite)			
200 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.750%, 11/01/28	193 070	0,00	500 000 EUR	BNG Bank NV, 0.010%, 20/01/31	459 772	0,01
1 000 000 USD	Mexico Government International Bond, 5.400%, 09/02/28	1 025 550	0,02	500 000 EUR	BNG Bank NV, 0.250%, 12/01/32	457 049	0,01
400 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.500%, 22/04/29	394 836	0,01	500 000 EUR	BNG Bank NV, 3.000%, 11/01/33	564 316	0,01
400 000 EUR	Mexico Government International Bond, 1.125%, 17/01/30	379 182	0,01	500 000 USD	Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV, 0.875%, 15/06/26	459 520	0,01
300 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.250%, 16/04/30	271 785	0,00	300 000 USD	Nederlandse Waterschapsbank NV, 1.750%, 15/01/25	290 529	0,00
200 000 EUR	Mexico Government International Bond, 3.375%, 23/02/31	214 176	0,00	300 000 EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.010%, 16/11/26	308 771	0,00
200 000 USD	Mexico Government International Bond, 2.659%, 24/05/31	169 226	0,00	500 000 EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.125%, 28/05/27	509 807	0,01
500 000 EUR	Mexico Government International Bond, 1.450%, 25/10/33	430 907	0,01	200 000 EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.050%, 28/01/30	190 700	0,00
500 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.500%, 12/02/34	423 795	0,01	300 000 EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 3.000%, 20/04/33	341 108	0,01
1 000 000 USD	Mexico Government International Bond, 6.350%, 09/02/35	1 048 460	0,02	400 000 EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.125%, 03/09/35	324 140	0,00
400 000 EUR	Mexico Government International Bond, 2.875%, 08/04/39	355 229	0,01	500 000 AUD	Nederlandse Waterschapsbank NV, 2.250%, perpetual	329 415	0,00
300 000 USD	Mexico Government International Bond, 6.050%, 11/01/40	302 748	0,00	1 800 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/25	1 920 328	0,03
450 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.280%, 14/08/41	372 105	0,01	2 500 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/26	2 631 663	0,04
150 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.750%, 08/03/44	128 763	0,00	1 900 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/26	2 010 768	0,03
100 000 EUR	Mexico Government International Bond, 3.000%, 06/03/45	85 690	0,00	2 000 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/27	2 069 827	0,03
200 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.600%, 23/01/46	166 830	0,00	1 550 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/27	1 632 864	0,02
200 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.350%, 15/01/47	160 918	0,00	747 685 EUR	Netherlands Government Bond, 5.500%, 15/01/28	931 426	0,01
300 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.500%, 31/01/50	244 944	0,00	1 650 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/28	1 715 755	0,03
200 000 EUR	Mexico Government International Bond, 2.125%, 25/10/51	133 570	0,00	1 600 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/29	1 589 706	0,02
200 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.771%, 24/05/61	135 614	0,00	1 100 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/29	1 097 650	0,02
200 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.750%, 19/04/71	133 126	0,00	1 000 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/30	961 289	0,01
Mexique – Total		28 968 112	0,43	1 400 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/31	1 313 173	0,02
Pays-Bas				1 800 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/32	1 716 719	0,03
400 000 EUR	BNG Bank NV, 0.050%, 02/04/25	425 966	0,01	1 230 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/01/33	1 383 041	0,02
100 000 GBP	BNG Bank NV, 1.625%, 26/08/25	121 269	0,00	1 700 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/07/33	1 905 698	0,03
100 000 EUR	BNG Bank NV, 0.125%, 11/04/26	104 547	0,00	1 814 697 EUR	Netherlands Government Bond, 4.000%, 15/01/37	2 339 715	0,04
500 000 USD	BNG Bank NV, 0.875%, 18/05/26	461 440	0,01	1 600 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/38	1 251 189	0,02
300 000 GBP	BNG Bank NV, 0.500%, 21/12/26	344 448	0,01	2 450 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/01/40	2 006 438	0,03
400 000 EUR	BNG Bank NV, 0.625%, 19/06/27	415 733	0,01	1 309 000 EUR	Netherlands Government Bond, 3.750%, 15/01/42	1 706 048	0,03
700 000 EUR	BNG Bank NV, 2.750%, 04/10/27	782 124	0,01				
500 000 EUR	BNG Bank NV, 0.010%, 31/08/28	492 425	0,01				
500 000 EUR	BNG Bank NV, 0.750%, 24/01/29	506 366	0,01				
300 000 AUD	BNG Bank NV, 3.300%, 26/04/29	193 682	0,00				
200 000 EUR	BNG Bank NV, 0.100%, 15/01/30	190 820	0,00				
800 000 EUR	BNG Bank NV, 3.000%, 23/04/30	905 884	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)					
Pays-Bas (suite)				Norvège (suite)					
1 000 000 EUR	Netherlands Government Bond, 3.250%, 15/01/44	1 230 116	0,02	5 500 000 NOK	Norway Government Bond, 1.750%, 06/09/29	499 228	0,01		
1 390 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.750%, 15/01/47	1 610 195	0,02	5 000 000 NOK	Norway Government Bond, 1.375%, 19/08/30	437 168	0,01		
1 800 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/52	1 025 204	0,02	1 000 000 NOK	Norway Government Bond, 1.250%, 17/09/31	85 198	0,00		
1 000 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.000%, 15/01/54	997 643	0,01	5 000 000 NOK	Norway Government Bond, 2.125%, 18/05/32	451 087	0,01		
800 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, perpetual	900 564	0,01	8 000 000 NOK	Norway Government Bond, 3.000%, 15/08/33	770 681	0,01		
Pays-Bas – Total			45 126 850	0,68	Norvège – Total			6 829 355	0,10
Nouvelle-Zélande				Panama					
1 500 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.750%, 15/04/25	923 417	0,01	100 000 USD	Panama Government International Bond, 8.875%, 30/09/27	109 043	0,00		
2 000 000 NZD	New Zealand Government Bond, 0.500%, 15/05/26	1 156 347	0,02	200 000 USD	Panama Government International Bond, 3.875%, 17/03/28	184 586	0,01		
1 200 000 NZD	New Zealand Government Bond, 4.500%, 15/04/27	764 939	0,01	200 000 USD	Panama Government International Bond, 3.160%, 23/01/30	170 630	0,00		
1 000 000 NZD	New Zealand Government Bond, 0.250%, 15/05/28	534 613	0,01	500 000 USD	Panama Government International Bond, 6.400%, 14/02/35	488 415	0,01		
1 200 000 NZD	New Zealand Government Bond, 3.000%, 20/04/29	718 471	0,01	100 000 USD	Panama Government International Bond, 4.500%, 15/05/47	70 951	0,00		
1 000 000 NZD	New Zealand Government Bond, 1.500%, 15/05/31	523 273	0,01	700 000 USD	Panama Government International Bond, 4.500%, 16/04/50	485 079	0,01		
750 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.000%, 15/05/32	398 751	0,01	200 000 USD	Panama Government International Bond, 4.300%, 29/04/53	134 048	0,00		
800 000 NZD	New Zealand Government Bond, 3.500%, 14/04/33	474 513	0,01	300 000 USD	Panama Government International Bond, 3.870%, 23/07/60	179 658	0,00		
1 650 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.750%, 15/04/37	858 762	0,01	Panama – Total			1 822 410	0,03	
2 150 000 NZD	New Zealand Government Bond, 1.750%, 15/05/41	896 030	0,01	Pérou					
800 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.750%, 15/05/51	361 214	0,00	5 700 000 PEN	Peru Government Bond, 5.940%, 12/02/29	1 538 951	0,02		
Nouvelle-Zélande – Total			7 610 330	0,11	3 000 000 PEN	Peru Government Bond, 5.400%, 12/08/34	733 803	0,01	
Norvège				2 500 000 PEN	Peru Government Bond, 5.350%, 12/08/40	579 390	0,01		
500 000 USD	Kommunalbanken AS, 0.375%, 11/09/25	466 340	0,01	75 000 USD	Peruvian Government International Bond, 7.350%, 21/07/25	77 450	0,00		
500 000 USD	Kommunalbanken AS, 0.500%, 13/01/26	462 340	0,01	300 000 USD	Peruvian Government International Bond, 2.392%, 23/01/26	285 303	0,01		
500 000 USD	Kommunalbanken AS, 1.125%, 26/10/26	458 880	0,01	100 000 EUR	Peruvian Government International Bond, 2.750%, 30/01/26	108 184	0,00		
100 000 EUR	Kommunalbanken AS, 0.875%, 24/05/27	104 501	0,00	200 000 USD	Peruvian Government International Bond, 8.750%, 21/11/33	251 288	0,00		
700 000 EUR	Kommunalbanken AS, 2.750%, 29/11/27	778 227	0,01	500 000 USD	Peruvian Government International Bond, 3.000%, 15/01/34	421 895	0,01		
300 000 EUR	Kommunalbanken AS, 0.050%, perpetual	287 518	0,00	300 000 EUR	Peruvian Government International Bond, 1.950%, 17/11/36	250 190	0,00		
8 500 000 NOK	Norway Government Bond, 1.750%, 13/03/25	816 538	0,01						
5 000 000 NOK	Norway Government Bond, 1.500%, 19/02/26	471 523	0,01						
3 900 000 NOK	Norway Government Bond, 1.750%, 17/02/27	365 956	0,00						
4 000 000 NOK	Norway Government Bond, 2.000%, 26/04/28	374 170	0,00						

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Pérou (suite)				Pologne (suite)			
1 000 000 USD	Peruvian Government International Bond, 3.300%, 11/03/41	776 220	0,01	4 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/26	958 342	0,01
500 000 USD	Peruvian Government International Bond, 3.600%, 15/01/72	351 910	0,01	5 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 0.250%, 25/10/26	1 118 177	0,02
Pérou – Total			0,08	1 500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.750%, 25/05/27	367 595	0,01
Philippines				1 705 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/27	400 788	0,01
100 000 USD	Philippine Government International Bond, 5.500%, 30/03/26	101 684	0,00	3 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/04/28	699 973	0,01
200 000 USD	Philippine Government International Bond, 3.000%, 01/02/28	188 822	0,00	4 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 7.500%, 25/07/28	1 119 715	0,02
1 000 000 USD	Philippine Government International Bond, 4.625%, 17/07/28	1 005 100	0,02	1 315 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 5.750%, 25/04/29	345 543	0,00
240 000 USD	Philippine Government International Bond, 3.750%, 14/01/29	231 540	0,00	2 200 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/10/29	499 797	0,01
500 000 USD	Philippine Government International Bond, 1.648%, 10/06/31	410 270	0,01	4 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.250%, 25/10/30	805 198	0,01
300 000 USD	Philippine Government International Bond, 1.950%, 06/01/32	247 839	0,00	4 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.750%, 25/04/32	791 028	0,01
300 000 EUR	Philippine Government International Bond, 1.200%, 28/04/33	265 225	0,00	6 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 6.000%, 25/10/33	1 617 700	0,02
100 000 USD	Philippine Government International Bond, 6.375%, 23/10/34	113 175	0,00	500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 4.000%, 25/04/47	106 368	0,00
200 000 USD	Philippine Government International Bond, 3.700%, 02/02/42	171 328	0,00	900 000 EUR	Republic of Poland Government International Bond, 0.010%, 10/02/25	958 176	0,01
500 000 USD	Philippine Government International Bond, 2.950%, 05/05/45	376 310	0,01	300 000 EUR	Republic of Poland Government International Bond, 1.500%, 19/01/26	321 831	0,00
500 000 USD	Philippine Government International Bond, 3.200%, 06/07/46	385 395	0,01	500 000 EUR	Republic of Poland Government International Bond, 1.125%, 07/08/26	524 107	0,01
500 000 USD	Philippine Government International Bond, 4.200%, 29/03/47	444 485	0,01	100 000 EUR	Republic of Poland Government International Bond, 1.375%, 22/10/27	105 111	0,00
500 000 USD	Philippine Government International Bond, 5.500%, 17/01/48	528 565	0,01	500 000 USD	Republic of Poland Government International Bond, 5.500%, 16/11/27	519 000	0,01
Philippines – Total			0,07	150 000 EUR	Republic of Poland Government International Bond, 1.000%, 07/03/29	152 541	0,00
Pologne				1 000 000 USD	Republic of Poland Government International Bond, 5.750%, 16/11/32	1 079 600	0,02
200 000 EUR	Bank Gospodarstwa Krajowego, 1.375%, 01/06/25	213 385	0,00	400 000 EUR	Republic of Poland Government International Bond, 3.875%, 14/02/33	460 091	0,01
500 000 EUR	Bank Gospodarstwa Krajowego, 3.000%, 30/05/29	538 064	0,01	100 000 EUR	Republic of Poland Government International Bond, 2.375%, 18/01/36	96 682	0,00
3 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 0.750%, 25/04/25	722 335	0,01	Pologne – Total			0,22
1 800 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.250%, 25/07/25	445 668	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Portugal				Roumanie			
1 300 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.875%, 15/10/25	1 447 117	0,02	3 000 000 RON	Romania Government Bond, 3.650%, 28/07/25	643 232	0,01
900 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.875%, 21/07/26	1 011 991	0,02	1 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.850%, 22/04/26	216 363	0,00
1 000 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.125%, 14/04/27	1 169 228	0,02	400 000 EUR	Romania Government Bond, 0.700%, 24/08/26	404 315	0,01
1 100 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.700%, 15/10/27	1 149 159	0,02	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.150%, 26/01/28	412 777	0,01
1 350 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.125%, 17/10/28	1 484 328	0,02	1 500 000 RON	Romania Government Bond, 5.000%, 12/02/29	315 158	0,00
1 800 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.950%, 15/06/29	1 953 713	0,03	4 000 000 RON	Romania Government Bond, 6.700%, 25/02/32	909 299	0,01
400 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 3.875%, 15/02/30	479 038	0,01	1 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.750%, 11/10/34	195 437	0,00
700 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.475%, 18/10/30	679 768	0,01	5 000 000 RON	Romania Government Bond, 7.900%, 24/02/38	1 279 143	0,02
1 300 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.300%, 17/10/31	1 211 247	0,02	200 000 EUR	Romanian Government International Bond, 2.375%, 19/04/27	208 242	0,00
1 450 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.650%, 16/07/32	1 483 662	0,02	500 000 USD	Romanian Government International Bond, 6.625%, 17/02/28	517 610	0,01
900 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.250%, 18/04/34	949 457	0,01	300 000 EUR	Romanian Government International Bond, 2.875%, 11/03/29	300 297	0,00
950 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.900%, 12/10/35	842 126	0,01	700 000 EUR	Romanian Government International Bond, 6.625%, 27/09/29	826 262	0,01
525 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.100%, 15/04/37	647 064	0,01	400 000 EUR	Romanian Government International Bond, 1.375%, 02/12/29	363 974	0,01
500 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 3.500%, 18/06/38	576 633	0,01	400 000 EUR	Romanian Government International Bond, 3.624%, 26/05/30	406 003	0,01
500 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.150%, 11/04/42	398 121	0,01	100 000 EUR	Romanian Government International Bond, 2.124%, 16/07/31	87 984	0,00
700 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.100%, 15/02/45	878 047	0,01	300 000 EUR	Romanian Government International Bond, 2.000%, 28/01/32	256 125	0,00
300 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.000%, 12/04/52	192 332	0,00	1 000 000 EUR	Romanian Government International Bond, 6.375%, 18/09/33	1 167 604	0,02
Portugal – Total		16 553 031	0,25	250 000 EUR	Romanian Government International Bond, 3.500%, 03/04/34	234 313	0,00
Qatar				200 000 EUR	Romanian Government International Bond, 3.375%, 08/02/38	172 650	0,00
300 000 USD	Qatar Government International Bond, 3.400%, 16/04/25	294 144	0,01	500 000 USD	Romanian Government International Bond, 4.000%, 14/02/51	361 180	0,01
200 000 USD	Qatar Government International Bond, 3.250%, 02/06/26	194 546	0,00	500 000 USD	Romanian Government International Bond, 7.625%, 17/01/53	558 965	0,01
200 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.500%, 23/04/28	202 606	0,00	400 000 EUR	Romanian Government International Bond, 2.750%, perpetual	434 132	0,01
300 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.000%, 14/03/29	297 972	0,01	Roumanie – Total		10 271 065	0,15
700 000 USD	Qatar Government International Bond, 3.750%, 16/04/30	684 033	0,01				
300 000 USD	Qatar Government International Bond, 5.750%, 20/01/42	330 972	0,01				
200 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.625%, 02/06/46	191 162	0,00				
500 000 USD	Qatar Government International Bond, 5.103%, 23/04/48	507 360	0,01				
300 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.817%, 14/03/49	292 539	0,00				
300 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.400%, 16/04/50	277 650	0,00				
Qatar – Total		3 272 984	0,05				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Arabie saoudite				Singapour (suite)			
1 500 000 USD	KSA Sukuk Ltd, 4.274%, 22/05/29	1 488 420	0,02	700 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/07/29	534 486	0,01
400 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.000%, 17/04/25	394 132	0,01	1 600 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/09/30	1 222 494	0,02
200 000 USD	Saudi Government International Bond, 3.250%, 26/10/26	192 946	0,00	1 000 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.625%, 01/07/31	701 895	0,01
300 000 USD	Saudi Government International Bond, 2.500%, 03/02/27	282 168	0,00	1 000 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.625%, 01/08/32	752 558	0,01
1 000 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.750%, 18/01/28	1 010 530	0,02	800 000 SGD	Singapore Government Bond, 3.375%, 01/09/33	640 904	0,01
200 000 USD	Saudi Government International Bond, 3.625%, 04/03/28	193 620	0,00	800 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.250%, 01/08/36	575 447	0,01
400 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.375%, 16/04/29	398 836	0,01	2 100 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.375%, 01/07/39	1 513 987	0,02
500 000 EUR	Saudi Government International Bond, 0.625%, 03/03/30	472 740	0,01	300 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.750%, 01/04/42	227 128	0,00
200 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.500%, 17/04/30	200 664	0,00	440 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.750%, 01/03/46	332 430	0,01
300 000 USD	Saudi Government International Bond, 2.750%, 03/02/32	263 712	0,00	500 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.875%, 01/03/50	318 425	0,00
500 000 USD	Saudi Government International Bond, 2.250%, 02/02/33	415 325	0,01	400 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.875%, 01/10/51	254 249	0,00
500 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.875%, 18/07/33	511 490	0,01	500 000 SGD	Singapore Government Bond, 3.000%, 01/08/72	405 724	0,01
100 000 EUR	Saudi Government International Bond, 2.000%, 09/07/39	85 415	0,00	Singapour – Total		12 371 951	0,19
200 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.500%, 26/10/46	177 262	0,00	Slovaquie			
700 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.625%, 04/10/47	628 782	0,01	500 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.250%, 14/05/25	531 663	0,01
300 000 USD	Saudi Government International Bond, 5.000%, 17/04/49	284 043	0,00	700 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.625%, 22/05/26	734 948	0,01
200 000 USD	Saudi Government International Bond, 5.250%, 16/01/50	196 184	0,00	500 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.000%, 12/06/28	512 088	0,01
500 000 USD	Saudi Government International Bond, 5.000%, 18/01/53	471 105	0,01	100 000 EUR	Slovakia Government Bond, 3.625%, 16/01/29	114 646	0,00
300 000 USD	Saudi Government International Bond, 3.750%, 21/01/55	228 459	0,00	500 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.750%, 09/04/30	484 831	0,01
500 000 USD	Saudi Government International Bond, 3.450%, 02/02/61	351 435	0,01	400 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.000%, 09/10/30	388 704	0,01
Arabie saoudite – Total		8 247 268	0,12	100 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.625%, 21/01/31	101 238	0,00
Singapour				500 000 EUR	Slovakia Government Bond, 4.000%, 19/10/32	589 104	0,01
450 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.375%, 01/06/25	336 048	0,01	400 000 EUR	Slovakia Government Bond, 3.875%, 08/02/33	469 423	0,01
900 000 SGD	Singapore Government Bond, 0.500%, 01/11/25	648 940	0,01	500 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.375%, 21/04/36	381 613	0,00
900 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.125%, 01/06/26	667 273	0,01	200 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.875%, 09/03/37	183 173	0,00
1 000 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.250%, 01/11/26	723 592	0,01	500 000 EUR	Slovakia Government Bond, 4.000%, 23/02/43	576 743	0,01
597 000 SGD	Singapore Government Bond, 3.500%, 01/03/27	460 900	0,01	100 000 EUR	Slovakia Government Bond, 2.000%, 17/10/47	81 875	0,00
800 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/09/27	609 731	0,01	Slovaquie – Total		5 150 049	0,08
900 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.625%, 01/05/28	681 082	0,01				
1 000 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/08/28	764 658	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Slovénie				Espagne (suite)			
70 000 EUR	Slovenia Government Bond, 5.125%, 30/03/26	81 125	0,00	4 350 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/26	4 549 350	0,07
350 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.000%, 06/03/28	362 351	0,01	2 200 000 EUR	Spain Government Bond, 1.950%, 30/04/26	2 393 923	0,04
300 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.188%, 14/03/29	307 568	0,01	3 000 000 EUR	Spain Government Bond, 2.800%, 31/05/26	3 327 670	0,05
600 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.875%, 15/07/30	589 254	0,01	1 550 000 EUR	Spain Government Bond, 5.900%, 30/07/26	1 850 349	0,03
500 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.010%, 12/02/31	453 851	0,01	2 900 000 EUR	Spain Government Bond, 1.300%, 31/10/26	3 096 745	0,05
700 000 EUR	Slovenia Government Bond, 3.625%, 11/03/33	818 916	0,01	2 300 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/27	2 351 820	0,04
200 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.500%, 25/03/35	186 732	0,00	3 500 000 EUR	Spain Government Bond, 1.500%, 30/04/27	3 740 660	0,06
200 000 EUR	Slovenia Government Bond, 3.125%, 07/08/45	219 684	0,00	2 000 000 EUR	Spain Government Bond, 0.800%, 30/07/27	2 080 410	0,03
400 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.488%, 20/10/50	230 647	0,00	2 500 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 31/10/27	2 655 303	0,04
100 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.688%, 03/03/81	54 778	0,00	1 800 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/28	1 796 413	0,03
Slovénie – Total		3 304 906	0,05	2 500 000 EUR	Spain Government Bond, 1.400%, 30/04/28	2 635 640	0,04
Espagne				3 200 000 EUR	Spain Government Bond, 1.400%, 30/07/28	3 364 358	0,05
200 000 EUR	Adif Alta Velocidad, 0.950%, 30/04/27	207 570	0,00	1 950 000 EUR	Spain Government Bond, 5.150%, 31/10/28	2 407 192	0,04
100 000 EUR	Adif Alta Velocidad, 3.500%, 30/07/28	113 050	0,00	1 671 787 EUR	Spain Government Bond, 6.000%, 31/01/29	2 146 576	0,03
300 000 EUR	Adif Alta Velocidad, 0.550%, 31/10/31	270 425	0,00	2 200 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 30/04/29	2 296 349	0,03
500 000 EUR	Autonomous Community of Andalusia Spain, 0.500%, 30/04/31	459 010	0,01	1 500 000 EUR	Spain Government Bond, 3.500%, 31/05/29	1 730 760	0,03
200 000 EUR	Autonomous Community of Madrid Spain, 1.826%, 30/04/25	216 832	0,00	4 200 000 EUR	Spain Government Bond, 0.800%, 30/07/29	4 207 915	0,06
500 000 EUR	Autonomous Community of Madrid Spain, 0.160%, 30/07/28	490 962	0,01	2 100 000 EUR	Spain Government Bond, 0.600%, 31/10/29	2 070 112	0,03
800 000 EUR	Autonomous Community of Madrid Spain, 3.362%, 31/10/28	908 376	0,01	2 400 000 EUR	Spain Government Bond, 0.500%, 30/04/30	2 322 019	0,04
100 000 EUR	Autonomous Community of Madrid Spain, 1.571%, 30/04/29	103 691	0,00	2 000 000 EUR	Spain Government Bond, 1.950%, 30/07/30	2 113 483	0,03
200 000 EUR	Autonomous Community of Madrid Spain, 2.080%, 12/03/30	210 507	0,00	2 200 000 EUR	Spain Government Bond, 1.250%, 31/10/30	2 211 680	0,03
300 000 EUR	Autonomous Community of Madrid Spain, 0.420%, 30/04/31	275 084	0,00	1 800 000 EUR	Spain Government Bond, 0.100%, 30/04/31	1 644 243	0,02
300 000 EUR	Basque Government, 0.450%, 30/04/32	270 157	0,00	2 700 000 EUR	Spain Government Bond, 0.500%, 31/10/31	2 508 657	0,04
500 000 EUR	Instituto de Credito Oficial, 0.010%, 30/04/25	529 939	0,01	2 300 000 EUR	Spain Government Bond, 0.700%, 30/04/32	2 144 017	0,03
2 100 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/25	2 245 347	0,03	2 411 000 EUR	Spain Government Bond, 5.750%, 30/07/32	3 251 291	0,05
1 750 000 EUR	Spain Government Bond, 1.600%, 30/04/25	1 899 095	0,03	3 400 000 EUR	Spain Government Bond, 2.550%, 31/10/32	3 662 065	0,06
1 900 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/05/25	2 014 231	0,03	4 300 000 EUR	Spain Government Bond, 3.150%, 30/04/33	4 829 131	0,07
2 200 000 EUR	Spain Government Bond, 4.650%, 30/07/25	2 496 405	0,04	2 000 000 EUR	Spain Government Bond, 2.350%, 30/07/33	2 101 022	0,03
3 400 000 EUR	Spain Government Bond, 2.150%, 31/10/25	3 719 792	0,06	1 500 000 EUR	Spain Government Bond, 3.550%, 31/10/33	1 735 400	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Espagne (suite)				Suède			
2 250 000 EUR	Spain Government Bond, 1.850%, 30/07/35	2 185 443	0,03	8 000 000 SEK	Kommuninvest I Sverige AB, 3.000%, 12/03/29	804 394	0,01
1 238 000 EUR	Spain Government Bond, 4.200%, 31/01/37	1 513 421	0,02	1 000 000 USD	Svensk Exportkredit AB, 4.625%, 28/11/25	1 000 720	0,01
3 600 000 EUR	Spain Government Bond, 0.850%, 30/07/37	2 932 687	0,04	500 000 USD	Svensk Exportkredit AB, 4.375%, 13/02/26	499 380	0,01
1 000 000 EUR	Spain Government Bond, 3.900%, 30/07/39	1 170 808	0,02	1 000 000 USD	Svensk Exportkredit AB, 4.875%, 14/09/26	1 015 080	0,01
1 250 000 EUR	Spain Government Bond, 4.900%, 30/07/40	1 636 733	0,02	1 000 000 USD	Svensk Exportkredit AB, 2.250%, 22/03/27	940 740	0,01
2 050 000 EUR	Spain Government Bond, 1.200%, 31/10/40	1 625 346	0,02	500 000 EUR	Svensk Exportkredit AB, 3.375%, 30/08/30	574 120	0,01
1 614 000 EUR	Spain Government Bond, 4.700%, 30/07/41	2 086 962	0,03	15 500 000 SEK	Sweden Government Bond, 2.500%, 12/05/25	1 530 044	0,02
1 750 000 EUR	Spain Government Bond, 1.000%, 30/07/42	1 294 081	0,02	11 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 1.000%, 12/11/26	1 053 671	0,02
1 600 000 EUR	Spain Government Bond, 3.450%, 30/07/43	1 752 311	0,03	11 300 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.750%, 12/05/28	1 060 991	0,02
1 400 000 EUR	Spain Government Bond, 5.150%, 31/10/44	1 925 838	0,03	2 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.750%, 12/11/29	184 948	0,00
1 650 000 EUR	Spain Government Bond, 2.900%, 31/10/46	1 648 516	0,03	14 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.125%, 12/05/31	1 215 759	0,02
3 000 000 EUR	Spain Government Bond, 2.700%, 31/10/48	2 852 814	0,04	2 500 000 SEK	Sweden Government Bond, 2.250%, 01/06/32	252 926	0,00
1 850 000 EUR	Spain Government Bond, 1.000%, 31/10/50	1 151 958	0,02	15 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 1.750%, 11/11/33	1 450 324	0,02
800 000 EUR	Spain Government Bond, 1.900%, 31/10/52	611 914	0,01	3 550 000 SEK	Sweden Government Bond, 3.500%, 30/03/39	410 821	0,01
1 770 000 EUR	Spain Government Bond, 3.450%, 30/07/66	1 833 322	0,03	5 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.500%, 24/11/45	348 229	0,01
1 200 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 31/10/71	669 895	0,01	2 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 1.375%, 23/06/71	134 993	0,00
Espagne – Total		120 547 075	1,81	20 000 000 SEK	Sweden Government International Bond, 0.125%, perpetual	1 757 756	0,03
Émissions supranationales				Suède – Total			
1 000 000 USD	European Stability Mechanism, 4.750%, 14/09/26	1 015 530	0,02	Suisse			
800 000 EUR	European Stability Mechanism, 3.000%, 15/03/28	905 283	0,01	200 000 CHF	Canton of Geneva Switzerland, 1.625%, 30/07/29	242 908	0,00
500 000 EUR	European Stability Mechanism, 3.000%, 23/08/33	570 883	0,01	400 000 CHF	Canton of Zurich, 0.100%, perpetual	380 785	0,01
1 500 000 EUR	European Union, 2.750%, 05/10/26	1 669 784	0,03	300 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.500%, 24/07/25	358 585	0,01
2 000 000 EUR	European Union, 3.125%, 05/12/28	2 276 839	0,03	800 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.250%, 28/05/26	956 901	0,02
500 000 EUR	European Union, 3.125%, 04/12/30	573 070	0,01	800 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 3.250%, 27/06/27	1 028 618	0,02
2 500 000 EUR	European Union, 3.250%, 04/07/34	2 894 377	0,04	346 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 4.000%, 08/04/28	466 127	0,01
500 000 EUR	European Union, 2.750%, 04/12/37	542 333	0,01	400 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.010%, 22/06/29	456 708	0,01
2 000 000 EUR	European Union, 3.375%, 04/10/38	2 321 533	0,03	400 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 27/05/30	469 017	0,01
700 000 EUR	European Union, 4.000%, 04/04/44	876 786	0,01	100 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.250%, 22/06/31	132 143	0,00
1 000 000 EUR	European Union, 2.625%, 04/02/48	1 029 026	0,02	800 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 27/06/32	933 490	0,01
Émissions supranationales – Total		14 675 444	0,22				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
Suisse (suite)				Thaïlande (suite)			
600 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 3.500%, 08/04/33	891 777	0,01	7 200 000 THB	Thailand Government Bond, 4.000%, 17/06/66	218 269	0,00
1 000 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.010%, 26/06/34	1 105 044	0,02	15 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.600%, 17/06/67	411 215	0,01
600 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.250%, 23/06/35	678 467	0,01	Thaïlande – Total			
600 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.500%, 08/03/36	864 024	0,01	17 747 292 0,27			
100 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.250%, 27/06/37	127 642	0,00	Émirats arabes unis			
1 600 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.500%, 26/10/38	2 123 258	0,03	300 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 2.500%, 16/04/25	290 922	0,00
1 450 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.010%, 24/07/39	1 554 230	0,02	300 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 3.125%, 11/10/27	288 312	0,00
700 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.500%, 30/04/42	952 546	0,02	500 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 1.625%, 02/06/28	448 965	0,01
1 000 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.250%, 28/06/43	1 319 396	0,02	500 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 3.125%, 16/04/30	470 955	0,01
800 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 28/06/45	924 736	0,01	350 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 4.125%, 11/10/47	306 611	0,00
100 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 4.000%, 06/01/49	211 740	0,00	300 000 USD	UAE International Government Bonds, 2.000%, 19/10/31	255 690	0,00
400 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 24/05/55	467 087	0,01	500 000 USD	UAE International Government Bonds, 2.875%, 19/10/41	381 290	0,01
200 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 30/05/58	238 895	0,00	500 000 USD	UAE International Government Bonds, 3.250%, 19/10/61	361 720	0,01
100 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.000%, 25/06/64	186 951	0,00	Émirats arabes unis – Total			
Suisse – Total				2 804 465 0,04			
Thaïlande				Royaume-Uni			
34 500 000 THB	Thailand Government Bond, 2.125%, 17/12/26	1 004 167	0,01	500 000 USD	Bank of England Euro Note, 2.000%, 21/03/25	484 045	0,01
60 000 000 THB	Thailand Government Bond, 1.000%, 17/06/27	1 675 939	0,02	500 000 USD	Bank of England Euro Note, 4.625%, 06/03/26	503 465	0,01
31 750 000 THB	Thailand Government Bond, 5.670%, 13/03/28	1 048 566	0,02	3 300 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.250%, 31/01/25	4 026 618	0,06
46 000 000 THB	Thailand Government Bond, 4.875%, 22/06/29	1 508 442	0,02	2 949 698 GBP	United Kingdom Gilt, 5.000%, 07/03/25	3 793 252	0,06
60 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.000%, 17/12/31	1 669 910	0,02	4 200 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.625%, 07/06/25	5 102 299	0,08
53 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.775%, 25/06/32	1 681 699	0,03	3 900 000 GBP	United Kingdom Gilt, 2.000%, 07/09/25	4 821 921	0,07
35 000 000 THB	Thailand Government Bond, 1.585%, 17/12/35	904 981	0,01	1 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.500%, 22/10/25	1 264 703	0,02
98 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.390%, 17/06/37	3 036 112	0,05	4 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.125%, 30/01/26	4 742 561	0,07
83 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.300%, 17/06/38	2 506 450	0,04	4 600 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.500%, 22/07/26	5 576 621	0,08
15 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.000%, 17/06/42	371 452	0,01	3 500 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.375%, 22/10/26	4 090 800	0,06
35 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.450%, 17/06/43	1 070 739	0,02	4 600 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.125%, 29/01/27	5 955 265	0,09
18 000 000 THB	Thailand Government Bond, 4.850%, 17/06/61	639 351	0,01	4 050 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.250%, 22/07/27	4 794 150	0,07
				3 055 926 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/27	4 017 551	0,06
				5 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.125%, 31/01/28	5 594 522	0,08

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)				
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)				
3 500 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.500%, 07/06/28	4 652 987	0,07	2 550 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.500%, 22/07/47	1 972 678	0,03	
3 500 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.625%, 22/10/28	4 131 938	0,06	2 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.750%, 22/01/49	1 613 310	0,02	
1 993 225 GBP	United Kingdom Gilt, 6.000%, 07/12/28	2 843 972	0,04	1 488 324 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/49	1 929 778	0,03	
5 500 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.500%, 31/01/29	6 088 488	0,09	3 100 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.625%, 22/10/50	1 745 466	0,03	
4 350 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.875%, 22/10/29	4 843 278	0,07	2 400 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.250%, 31/07/51	1 630 571	0,02	
4 200 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.375%, 22/10/30	4 385 323	0,07	1 390 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.750%, 22/07/52	1 664 785	0,03	
3 107 283 GBP	United Kingdom Gilt, 4.750%, 07/12/30	4 286 731	0,06	1 100 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.500%, 31/07/53	782 107	0,01	
6 900 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.250%, 31/07/31	6 957 993	0,10	2 300 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.750%, 22/10/53	2 739 434	0,04	
3 200 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.000%, 31/01/32	3 382 196	0,05	1 730 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.625%, 22/10/54	1 262 858	0,02	
3 860 902 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/06/32	5 212 612	0,08	3 361 040 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/55	4 394 982	0,07	
3 800 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.250%, 31/01/33	4 740 330	0,07	2 550 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.750%, 22/07/57	1 896 481	0,03	
5 350 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.875%, 31/07/33	5 342 859	0,08	2 505 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.000%, 22/01/60	3 151 476	0,05	
1 500 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.625%, 31/01/34	2 075 826	0,03	2 600 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.500%, 22/10/61	1 117 112	0,02	
3 400 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.500%, 07/09/34	4 654 668	0,07	1 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.000%, 22/10/63	1 259 681	0,02	
3 450 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.625%, 31/07/35	3 128 647	0,05	2 070 000 GBP	United Kingdom Gilt, 2.500%, 22/07/65	1 849 955	0,03	
3 225 256 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/03/36	4 310 760	0,06	2 200 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.500%, 22/07/68	2 520 822	0,04	
2 850 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.750%, 07/09/37	2 821 963	0,04	2 645 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.625%, 22/10/71	1 739 939	0,03	
1 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.750%, 29/01/38	1 249 469	0,02	5 650 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.125%, 22/10/73	3 017 537	0,05	
2 095 721 GBP	United Kingdom Gilt, 4.750%, 07/12/38	2 914 208	0,04	Royaume-Uni – Total			198 194 595	2,97
2 200 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.125%, 31/01/39	1 908 110	0,03	États-Unis				
1 760 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/09/39	2 309 027	0,03	500 000 USD	Alabama Federal Aid Highway Finance Authority, 2.650%, perpetual	401 636	0,01	
3 300 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/40	4 314 828	0,06	190 000 USD	American Municipal Power Inc, 8.084%, 15/02/50	256 980	0,00	
5 350 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.250%, 22/10/41	4 429 501	0,07	100 000 USD	Board of Regents of the University of Texas System, 3.354%, 15/08/47	78 853	0,00	
2 354 981 GBP	United Kingdom Gilt, 4.500%, 07/12/42	3 166 826	0,05	100 000 USD	California State University, 2.975%, 01/11/51	71 422	0,00	
1 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.750%, 22/10/43	1 380 557	0,02	300 000 USD	California State University, 2.939%, perpetual	210 366	0,00	
2 590 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.250%, 22/01/44	2 910 179	0,04	281 387 USD	Chicago Transit Authority Sales & Transfer Tax Receipts Revenue, 6.899%, 01/12/40	321 369	0,01	
3 300 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.500%, 22/01/45	3 833 440	0,06	50 000 USD	City of Houston, 3.961%, 01/03/47	44 573	0,00	
4 100 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.875%, 31/01/46	2 795 959	0,04	200 000 USD	Commonwealth Financing Authority, 4.144%, 01/06/38	186 195	0,00	
1 597 948 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/46	2 065 175	0,03					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
55 000 USD	Commonwealth of Massachusetts, 2.514%, 01/07/41	41 337	0,00	2 000 USD	North Texas Tollway Authority, 6.718%, 01/01/49	2 444	0,00
300 000 USD	County of Miami-Dade Aviation Revenue, 4.280%, 01/10/41	271 295	0,00	260 000 USD	Ohio State University, 4.800%, 01/06/11	249 049	0,00
250 000 USD	Dallas Fort Worth International Airport, 3.089%, perpetual	203 776	0,00	500 000 USD	Port Authority of New York & New Jersey, 5.072%, 15/07/53	517 167	0,01
500 000 USD	Dallas Fort Worth International Airport, 2.843%, perpetual	377 569	0,01	200 000 USD	Port Authority of New York & New Jersey, 4.458%, 01/10/62	184 018	0,00
2 500 000 USD	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0.870%, 01/09/26	2 280 175	0,03	250 000 USD	Port Authority of New York & New Jersey, 3.287%, 01/08/69	175 877	0,00
3 000 000 USD	Federal Home Loan Banks, 0.550%, 12/02/26	2 762 670	0,04	35 000 USD	Rutgers The State University of New Jersey, 3.915%, perpetual	25 813	0,00
5 000 000 USD	Federal Home Loan Banks, 1.250%, 21/12/26	4 601 300	0,07	195 000 USD	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District, 4.839%, 01/01/41	193 575	0,00
315 000 USD	Federal Home Loan Banks, 3.250%, 16/11/28	306 212	0,00	50 000 USD	State Board of Administration Finance Corp, 1.258%, perpetual	47 446	0,00
300 000 USD	Federal Home Loan Banks, 5.500%, 15/07/36	337 158	0,01	50 000 USD	State Board of Administration Finance Corp, 1.705%, perpetual	45 356	0,00
10 000 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 5.150%, 14/02/25	9 992 000	0,15	50 000 USD	State Board of Administration Finance Corp, 2.154%, perpetual	42 660	0,00
925 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 0.375%, 23/09/25	863 673	0,01	600 000 USD	State of California, 7.500%, 01/04/34	728 216	0,01
200 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.750%, 15/03/31	233 222	0,00	500 000 USD	State of California, 5.125%, 01/03/38	503 194	0,01
100 000 USD	Federal Home Loan Mortgage Corp, 6.250%, 15/07/32	116 124	0,00	200 000 USD	State of California, 7.625%, 01/03/40	252 191	0,00
1 440 000 USD	Federal National Mortgage Association, 1.625%, 07/01/25	1 395 418	0,02	400 000 USD	State of Illinois, 5.100%, 01/06/33	395 953	0,01
2 000 000 USD	Federal National Mortgage Association, 0.625%, 22/04/25	1 899 960	0,03	430 000 USD	Tennessee Valley Authority, 0.750%, 15/05/25	407 808	0,01
1 500 000 USD	Federal National Mortgage Association, 0.700%, 30/07/25	1 410 975	0,02	125 000 USD	Tennessee Valley Authority, 6.750%, 01/11/25	129 919	0,00
300 000 USD	Federal National Mortgage Association, 1.875%, 24/09/26	283 293	0,00	275 000 USD	Tennessee Valley Authority, 7.125%, 01/05/30	320 482	0,01
375 000 USD	Federal National Mortgage Association, 6.625%, 15/11/30	431 835	0,01	300 000 USD	Tennessee Valley Authority, 5.250%, 15/09/39	318 852	0,01
1 050 000 USD	Federal National Mortgage Association, 5.625%, 15/07/37	1 199 016	0,02	200 000 USD	Texas Transportation Commission, 2.472%, 01/10/44	143 949	0,00
200 000 USD	Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency, 3.924%, 15/01/53	159 465	0,00	50 000 000 USD	United States Treasury Bill, zero coupon, 16/01/24	49 897 771	0,75
65 000 USD	Grand Parkway Transportation Corp, 3.236%, 01/10/52	49 143	0,00	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/01/25	4 816 797	0,07
20 000 USD	JobsOhio Beverage System, 2.833%, 01/01/38	16 322	0,00	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/01/25	4 825 000	0,07
575 000 USD	Los Angeles Unified School District, 5.750%, 01/07/34	613 532	0,01	1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 31/01/25	976 563	0,01
100 000 USD	Los Angeles Unified School District, 6.758%, 01/07/34	113 274	0,00	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/02/25	3 396 641	0,05
20 000 USD	Massachusetts School Building Authority, 3.395%, 15/10/40	17 219	0,00	200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 7.625%, 15/02/25	206 648	0,00
100 000 USD	Massachusetts School Building Authority, 2.950%, perpetual	75 537	0,00	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 28/02/25	4 801 758	0,07
100 000 USD	Metropolitan Transportation Authority, 7.336%, 15/11/39	124 441	0,00	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 28/02/25	2 935 313	0,04
400 000 USD	New Jersey Turnpike Authority, 7.414%, 01/01/40	501 667	0,01	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 28/02/25	4 996 094	0,08
				5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 15/03/25	4 832 031	0,07

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/03/25	4 754 102	0,07	1 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 28/02/26	1 447 852	0,02
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/03/25	976 406	0,01	10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/03/26	9 281 250	0,14
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 30/04/25	2 839 102	0,04	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 30/04/26	4 626 953	0,07
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 30/04/25	2 934 492	0,04	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 30/04/26	1 922 188	0,03
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/04/25	4 955 078	0,07	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/05/26	4 718 750	0,07
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.125%, 15/05/25	1 936 172	0,03	10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/05/26	9 887 500	0,15
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/05/25	4 880 469	0,07	15 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/05/26	13 851 562	0,21
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/05/25	2 824 922	0,04	15 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 15/06/26	15 002 344	0,22
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 31/05/25	2 931 445	0,04	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.875%, 30/06/26	4 624 609	0,07
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 31/05/25	7 970 312	0,12	4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 30/06/26	3 794 063	0,06
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/06/25	4 887 109	0,07	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/07/26	5 048 047	0,08
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 30/06/25	939 297	0,01	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 31/07/26	4 580 859	0,07
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 30/06/25	5 012 109	0,08	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 31/07/26	4 731 641	0,07
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/07/25	4 682 422	0,07	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 15/08/26	2 340 234	0,04
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/08/25	962 344	0,01	10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/08/26	10 070 312	0,15
15 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/08/25	14 700 586	0,22	9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/08/26	8 254 687	0,12
300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.875%, 15/08/25	310 711	0,00	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/08/26	4 662 500	0,07
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/08/25	9 337 109	0,14	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.875%, 30/09/26	4 594 141	0,07
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 30/09/25	9 313 281	0,14	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 31/10/26	4 615 234	0,07
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 15/10/25	4 991 211	0,08	6 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 31/10/26	5 618 906	0,08
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/11/25	963 203	0,01	1 100 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/11/26	1 040 445	0,02
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/11/25	5 017 383	0,08	20 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 15/11/26	20 323 438	0,30
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 31/12/25	4 634 570	0,07	325 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.500%, 15/11/26	345 490	0,01
15 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 31/01/26	13 857 422	0,21	15 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/11/26	13 873 828	0,21
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/01/26	2 906 250	0,04	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 31/12/26	6 463 516	0,10
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/02/26	2 369 531	0,04	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 31/12/26	4 686 328	0,07
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 15/02/26	4 978 125	0,07	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 31/01/27	4 643 750	0,07
635 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.000%, 15/02/26	654 993	0,01	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/02/27	1 899 219	0,03
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 28/02/26	4 620 703	0,07	200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.625%, 15/02/27	214 734	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 28/02/27	1 832 656	0,03	10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 31/03/28	9 898 437	0,15
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 28/02/27	4 689 453	0,07	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/04/28	4 480 078	0,07
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 31/03/27	4 495 703	0,07	4 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/28	4 318 945	0,06
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 31/03/27	9 561 719	0,14	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 31/05/28	4 470 703	0,07
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 30/04/27	2 679 375	0,04	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 31/05/28	6 932 734	0,10
3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/05/27	3 326 094	0,05	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/06/28	4 462 500	0,07
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/05/27	2 672 578	0,04	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 30/06/28	5 028 125	0,08
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/05/27	9 577 344	0,14	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.000%, 31/07/28	4 400 781	0,07
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 30/06/27	4 443 359	0,07	8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/07/28	8 090 000	0,12
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.250%, 30/06/27	9 776 562	0,15	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/08/28	2 873 438	0,04
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 31/07/27	1 765 156	0,03	315 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.500%, 15/08/28	336 632	0,01
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 31/07/27	9 605 469	0,14	4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 31/08/28	3 534 688	0,05
3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/08/27	3 302 031	0,05	10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 31/08/28	10 223 437	0,15
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/08/27	3 536 563	0,05	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/09/28	4 434 766	0,07
15 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 31/08/27	14 587 500	0,22	7 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 30/09/28	7 749 023	0,12
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 30/09/27	1 755 469	0,03	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/10/28	4 455 078	0,07
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 30/09/27	5 033 984	0,08	7 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/11/28	7 253 906	0,11
6 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/10/27	5 279 531	0,08	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.250%, 15/11/28	5 298 437	0,08
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/10/27	5 034 375	0,08	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 30/11/28	4 475 000	0,07
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/11/27	1 881 563	0,03	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 30/11/28	5 121 875	0,08
50 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.125%, 15/11/27	53 863	0,00	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/12/28	4 440 625	0,07
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 30/11/27	3 527 813	0,05	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 31/01/29	4 516 016	0,07
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/11/27	3 993 750	0,06	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 15/02/29	2 828 203	0,04
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 31/12/27	2 997 422	0,05	1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.250%, 15/02/29	1 060 391	0,02
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/01/28	7 058 125	0,11	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 28/02/29	4 539 063	0,07
5 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/02/28	4 972 906	0,07	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 31/03/29	4 647 266	0,07
6 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 29/02/28	5 368 125	0,08	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 30/04/29	4 762 500	0,07
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 29/02/28	10 040 625	0,15	2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/05/29	1 856 719	0,03
6 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 31/03/28	5 385 469	0,08	13 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 31/05/29	12 292 109	0,18

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.250%, 30/06/29	4 846 875	0,07	10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 15/02/33	9 717 187	0,15
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/07/29	4 689 063	0,07	12 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, 15/05/33	11 542 500	0,17
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/08/29	2 227 930	0,03	10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/08/33	10 007 812	0,15
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 31/08/29	4 809 375	0,07	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/11/33	5 260 156	0,08
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/09/29	4 997 656	0,08	6 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/02/36	6 413 437	0,10
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 31/10/29	5 031 250	0,08	750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 15/02/37	822 773	0,01
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 15/11/29	2 681 484	0,04	300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.000%, 15/05/37	336 328	0,01
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/11/29	4 998 437	0,08	525 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/02/38	553 301	0,01
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 31/01/30	4 897 656	0,07	325 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/05/38	346 328	0,01
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 15/02/30	3 490 000	0,05	475 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 15/02/39	451 102	0,01
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 31/03/30	4 930 078	0,07	1 400 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 15/05/39	1 446 813	0,02
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 30/04/30	4 894 922	0,07	1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/08/39	1 061 563	0,02
7 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 15/05/30	6 139 453	0,09	925 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/11/39	966 480	0,01
200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.250%, 15/05/30	226 125	0,00	1 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 15/02/40	1 449 773	0,02
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 31/05/30	4 963 281	0,07	3 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/05/40	2 425 781	0,04
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 31/07/30	4 028 750	0,06	1 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/05/40	1 354 234	0,02
8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 15/08/30	6 907 578	0,10	5 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/08/40	3 523 438	0,05
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/08/30	4 056 875	0,06	1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/08/40	978 125	0,01
4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.875%, 31/10/30	4 238 125	0,06	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 15/11/40	4 661 563	0,07
6 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.875%, 15/11/30	4 937 813	0,07	1 050 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 15/11/40	1 073 461	0,02
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 30/11/30	5 150 781	0,08	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 15/02/41	5 052 031	0,08
9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/02/31	7 526 250	0,11	1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 15/02/41	1 084 688	0,02
9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/05/31	7 732 969	0,12	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/05/41	3 821 875	0,06
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 15/08/31	8 293 750	0,12	1 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/05/41	1 654 500	0,03
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 15/11/31	8 318 750	0,12	6 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 15/08/41	4 711 289	0,07
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 15/02/32	6 891 250	0,10	1 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 15/08/41	1 193 555	0,02
13 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/32	12 533 906	0,19	6 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/11/41	4 355 625	0,07
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/08/32	9 176 562	0,14	935 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/11/41	815 641	0,01
12 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 15/11/32	12 732 422	0,19	4 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/02/42	3 465 703	0,05

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'État – 63,42 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
1 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/02/42	1 130 391	0,02	2 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/08/47	2 033 688	0,03
1 400 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/05/42	1 188 688	0,02	3 400 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/11/47	2 658 375	0,04
6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.250%, 15/05/42	5 725 078	0,09	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/02/48	2 045 703	0,03
1 525 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/08/42	1 240 730	0,02	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/05/48	2 927 969	0,04
7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, 15/08/42	6 265 000	0,09	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/08/48	2 861 250	0,04
1 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/11/42	1 378 859	0,02	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, 15/11/48	4 375 000	0,07
6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 15/11/42	6 340 547	0,10	4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/02/49	3 269 375	0,05
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/02/43	857 969	0,01	4 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/49	3 193 125	0,05
8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/02/43	8 134 766	0,12	6 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/08/49	4 208 438	0,06
1 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/43	1 400 641	0,02	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/11/49	2 521 641	0,04
12 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/05/43	11 484 375	0,17	5 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/02/50	3 834 344	0,06
1 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/08/43	1 660 781	0,03	16 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 15/05/50	8 670 000	0,13
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/08/43	2 049 063	0,03	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 15/08/50	3 920 000	0,06
675 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 15/11/43	632 707	0,01	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/11/50	4 190 156	0,06
5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 15/11/43	5 381 250	0,08	8 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 15/02/51	5 259 375	0,08
1 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/02/44	1 608 359	0,02	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/05/51	5 019 219	0,08
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, 15/05/44	2 211 328	0,03	6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/08/51	4 264 609	0,06
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/08/44	2 547 656	0,04	9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 15/11/51	5 716 406	0,09
1 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/11/44	1 453 047	0,02	5 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/02/52	3 831 094	0,06
2 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 15/02/45	1 785 633	0,03	6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/52	5 198 984	0,08
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/05/45	827 656	0,01	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/08/52	4 107 813	0,06
2 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/08/45	1 820 391	0,03	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 15/11/52	4 954 687	0,07
815 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/11/45	672 757	0,01	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/02/53	4 638 281	0,07
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 15/02/46	1 505 938	0,02	5 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/05/53	5 108 984	0,08
2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 15/05/46	1 878 516	0,03	5 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 15/08/53	5 078 125	0,08
3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/08/46	2 141 719	0,03	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 15/11/53	3 380 156	0,05
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/11/46	803 750	0,01	5 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, perpetual	4 838 711	0,07
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/02/47	1 641 250	0,02	3 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, perpetual	2 999 063	0,05
2 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/05/47	1 640 313	0,02	50 000 USD	University of California, 3.063%, 01/07/25	48 737	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Autres valeurs mobilières (suite)			
Obligations d'État – 63,42 % (suite)				Obligations d'entreprise – 0,30 % (suite)			
États-Unis (suite)				Canada (suite)			
300 000 USD	University of California, 3.349%, 01/07/29	284 092	0,00	300 000 CAD	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada, 3.600%, 29/09/27	222 174	0,00
100 000 USD	University of California, 4.858%, 15/05/12	93 656	0,00	300 000 CAD	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada, 2.500%, 14/05/30	203 484	0,00
50 000 USD	University of California, 4.767%, 15/05/15	45 719	0,00	200 000 CAD	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada, 4.450%, 27/02/47	139 732	0,00
1 000 000 USD	University of Michigan, 4.454%, 01/04/22	896 339	0,01	100 000 CAD	British Columbia Ferry Services Inc, 4.289%, 28/04/44	74 529	0,00
60 000 USD	University of Virginia, 2.256%, 01/09/50	37 953	0,00	200 000 CAD	Brookfield Corp, 3.800%, 16/03/27	148 573	0,00
États-Unis – Total		1 175 755 536	17,61	500 000 CAD	Bruce Power LP, 4.990%, 21/12/32	389 462	0,01
Uruguay				200 000 CAD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 3.300%, 26/05/25	149 034	0,00
200 000 USD	Uruguay Government International Bond, 4.375%, 27/10/27	201 382	0,00	500 000 CAD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 5.350%, 20/04/33	384 047	0,01
230 000 USD	Uruguay Government International Bond, 4.375%, 23/01/31	228 015	0,01	200 000 CAD	Canadian National Railway Co, 2.800%, 22/09/25	147 282	0,00
243 467 USD	Uruguay Government International Bond, 4.125%, 20/11/45	220 822	0,00	500 000 CAD	Canadian National Railway Co, 4.400%, 10/05/33	384 575	0,01
200 000 USD	Uruguay Government International Bond, 5.100%, 18/06/50	200 688	0,00	300 000 CAD	Canadian Western Bank, 2.606%, 30/01/25	220 937	0,00
Uruguay – Total		850 907	0,01	200 000 CAD	CU Inc, 3.763%, 19/11/46	136 325	0,00
Total des obligations d'État		4 233 337 839	63,42	300 000 CAD	CU Inc, 3.548%, 22/11/47	196 795	0,00
Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				500 000 CAD	Daimler Truck Finance Canada Inc, 5.810%, 25/09/26	390 137	0,01
				200 000 CAD	Enbridge Gas Inc, 2.880%, 22/11/27	145 027	0,00
				200 000 CAD	Enbridge Gas Inc, 4.950%, 22/11/50	160 557	0,00
Autres valeurs mobilières				300 000 CAD	Enbridge Inc, 2.990%, 03/10/29	210 198	0,00
Obligations d'entreprise – 0,30 %				500 000 CAD	Enbridge Inc, 5.360%, 26/05/33	393 664	0,01
Australie				200 000 CAD	Enbridge Inc, 4.570%, 11/03/44	138 386	0,00
200 000 AUD	Qantas Airways Ltd, 2.950%, 27/11/29	117 216	0,00	300 000 CAD	Enbridge Pipelines Inc, 4.550%, 17/08/43	209 939	0,00
Australie – Total		117 216	0,00	300 000 CAD	EPCOR Utilities Inc, 3.554%, 27/11/47	197 578	0,00
Canada				300 000 CAD	Fairfax Financial Holdings Ltd, 4.250%, 06/12/27	223 944	0,01
300 000 CAD	407 International Inc, 3.720%, 11/05/48	202 995	0,00	100 000 CAD	Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 2.856%, 26/05/30	73 311	0,00
100 000 CAD	407 International Inc, 3.980%, 11/09/52	70 388	0,00	100 000 CAD	First Capital Real Estate Investment Trust, 3.456%, 22/01/27	71 554	0,00
200 000 CAD	55 Ontario School Board Trust, 5.900%, 02/06/33	172 583	0,00	500 000 CAD	Fortis Inc, 5.677%, 08/11/33	411 273	0,01
400 000 CAD	Aéroports de Montreal, 3.030%, 21/04/50	242 818	0,01	300 000 CAD	FortisBC Energy Inc, 2.820%, 09/08/49	170 187	0,00
300 000 CAD	AltaGas Ltd, 2.157%, 10/06/25	218 939	0,00	300 000 CAD	Greater Toronto Airports Authority, 2.730%, 03/04/29	215 447	0,00
300 000 CAD	AltaLink LP, 2.747%, 29/05/26	220 172	0,00	300 000 CAD	Honda Canada Finance Inc, 3.444%, 23/05/25	223 624	0,01
200 000 CAD	Bank of Montreal, 2.700%, 09/12/26	145 632	0,00	300 000 CAD	Hydro One Inc, 2.770%, 24/02/26	221 291	0,00
200 000 CAD	Bank of Montreal, 3.190%, 01/03/28	146 449	0,00	100 000 CAD	Hydro One Inc, 6.590%, 22/04/43	96 378	0,00
500 000 CAD	Bank of Montreal, 5.039%, 29/05/28	388 014	0,01	100 000 CAD	Hydro One Inc, 3.720%, 18/11/47	67 795	0,00
200 000 CAD	Bank of Montreal, 2.077%, 17/06/30	145 233	0,00	700 000 CAD	Inter Pipeline Ltd/AB, 5.849%, 18/05/32	546 776	0,01
800 000 CAD	Bank of Montreal, 6.534%, 27/10/32	639 521	0,01	200 000 CAD	Manulife Financial Corp, 2.818%, 13/05/35	134 952	0,00
300 000 CAD	Bank of Nova Scotia, 2.620%, 02/12/26	217 997	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Autres valeurs mobilières (suite)				Autres valeurs mobilières (suite)				
Obligations d'entreprise – 0,30 % (suite)				Obligations d'entreprise – 0,30 % (suite)				
Canada (suite)				Canada (suite)				
500 000	CAD National Bank of Canada, 5.219%, 14/06/28	390 661	0,01	800 000	CAD Toronto-Dominion Bank, 5.376%, 21/10/27	626 082	0,01	
400 000	CAD NAV Canada, 2.924%, 29/09/51	239 205	0,01	500 000	CAD Toronto-Dominion Bank, 4.477%, 18/01/28	379 861	0,01	
200 000	CAD North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd, 3.650%, 01/06/35	139 524	0,00	500 000	CAD Toronto-Dominion Bank, 4.680%, 08/01/29	383 820	0,01	
100 000	CAD North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd, 4.350%, 10/01/39	73 008	0,00	500 000	CAD Toronto-Dominion Bank, 3.105%, 22/04/30	368 925	0,01	
300 000	CAD OMERS Realty Corp, 3.331%, 05/06/25	223 194	0,00	400 000	CAD TransCanada PipeLines Ltd, 3.800%, 05/04/27	297 616	0,01	
500 000	CAD Ontario Power Generation Inc, 3.215%, 08/04/30	358 300	0,01	1 000 000	CAD TransCanada PipeLines Ltd, 5.277%, 15/07/30	785 902	0,01	
300 000	CAD Pembina Pipeline Corp, 3.310%, 01/02/30	211 131	0,00	100 000	CAD TransCanada PipeLines Ltd, 4.350%, 06/06/46	66 608	0,00	
100 000	CAD Pembina Pipeline Corp, 4.540%, 03/04/49	66 797	0,00	300 000	CAD TransCanada PipeLines Ltd, 4.180%, 03/07/48	192 902	0,00	
500 000	CAD RioCan Real Estate Investment Trust, 5.962%, 01/10/29	390 930	0,01	500 000	CAD VW Credit Canada Inc, 5.730%, 20/09/28	396 504	0,01	
200 000	CAD Rogers Communications Inc, 3.800%, 01/03/27	148 724	0,00	Canada – Total			18 680 571	0,28
500 000	CAD Rogers Communications Inc, 5.900%, 21/09/33	408 471	0,01	Émissions supranationales				
200 000	CAD Royal Bank of Canada, 1.936%, 01/05/25	146 199	0,00	700 000	AUD Asian Development Bank, 3.900%, 17/02/26	474 917	0,01	
500 000	CAD Royal Bank of Canada, 4.642%, 17/01/28	382 261	0,01	500 000	AUD Asian Development Bank, 4.250%, 17/01/28	341 953	0,00	
100 000	CAD Royal Bank of Canada, 2.088%, 30/06/30	72 668	0,00	Émissions supranationales – Total			816 870	0,01
200 000	CAD SmartCentres Real Estate Investment Trust, 3.526%, 20/12/29	138 451	0,00	États-Unis				
200 000	CAD Telus Corp, 3.300%, 02/05/29	143 763	0,00	300 000	CAD Bank of America Corp, 3.515%, 24/03/26	222 943	0,01	
300 000	CAD Telus Corp, 3.150%, 19/02/30	211 083	0,00	50 000	CAD Manulife Finance Delaware LP, 5.059%, 15/12/41	37 784	0,00	
500 000	CAD Telus Corp, 4.950%, 28/03/33	384 161	0,01	200 000	CAD Mondelez International Inc, 3.250%, 07/03/25	148 726	0,00	
300 000	CAD Telus Corp, 4.700%, 06/03/48	211 806	0,00	100 000	CAD Verizon Communications Inc, 2.500%, 16/05/30	67 784	0,00	
500 000	CAD Teranet Holdings LP, 3.719%, 23/02/29	353 955	0,01	États-Unis – Total			477 237	0,01
100 000	CAD Teranet Holdings LP, 5.754%, 17/12/40	74 926	0,00	Total des obligations d'entreprise			20 091 894	0,30
200 000	CAD Thomson Reuters Corp, 2.239%, 14/05/25	146 592	0,00	Total des autres valeurs mobilières			20 091 894	0,30
500 000	CAD Toronto-Dominion Bank, 2.260%, 07/01/27	356 833	0,01	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			6 556 134 107	98,21

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – (0,37) %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	229 000	141 337	96	0,00
Bought AUD / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	41 000	27 027	950	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	10 317 000	7 062 598	22 460	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	408 000	278 629	1 385	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CAD / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	144 137 000	85 683 629	84 092	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 04/01/24	Bank of Montreal	59 354 000	44 966 122	48 214	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	494 000	374 166	486	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	73 000	53 762	1 601	0,00
Bought CHF / Sold AUD, due 04/01/24	UBS AG	59 064	102 000	574	0,00
Bought CHF / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	59 367	102 000	1 096	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 04/01/24	Bank of Montreal	7 073	11 000	62	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 04/01/24	UBS AG	109 428	170 000	1 087	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	114 651	178 000	1 618	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 135	34 000	119	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	2 684	22 000	87	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	UBS AG	397 766	3 240 000	15 716	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 05/02/24	UBS AG	384 249	3 227 000	1 576	0,00
Bought CHF / Sold COP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	7 577	34 854 000	96	0,00
Bought CHF / Sold CZK, due 04/01/24	UBS AG	6 119	155 000	335	0,00
Bought CHF / Sold CZK, due 05/02/24	UBS AG	5 895	155 000	100	0,00
Bought CHF / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	8 764	68 000	336	0,00
Bought CHF / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	8 593	68 000	150	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 364 468	1 446 094	23 693	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	471 753	491 000	18 106	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	495 357	516 000	18 534	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	468 650	498 000	7 851	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	468 703	498 000	7 913	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	18 852 000	17 340 894	292 576	0,01
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	Citibank NA	6 595	6 000	187	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	168 512	152 000	6 445	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	167 937	155 000	2 567	0,00
Bought CHF / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	3 768	1 489 000	174	0,00
Bought CHF / Sold HUF, due 05/02/24	UBS AG	3 652	1 489 000	69	0,00
Bought CHF / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	21 443	380 416 000	771	0,00
Bought CHF / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	21 144	380 416 000	506	0,00
Bought CHF / Sold ILS, due 04/01/24	UBS AG	6 189	26 000	133	0,00
Bought CHF / Sold ILS, due 05/02/24	UBS AG	6 108	26 000	56	0,00
Bought CHF / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	233 385	38 939 000	669	0,00
Bought CHF / Sold JPY, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	233 403	38 939 000	691	0,00
Bought CHF / Sold KRW, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	53 440	78 929 000	2 205	0,00
Bought CHF / Sold KRW, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	52 187	78 929 000	815	0,00
Bought CHF / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	13 796	273 000	273	0,00
Bought CHF / Sold MXN, due 06/02/24	UBS AG	13 610	273 000	192	0,00
Bought CHF / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	13 363	71 000	425	0,00
Bought CHF / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	13 107	71 000	139	0,00
Bought CHF / Sold NOK, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	4 276	51 000	71	0,00
Bought CHF / Sold NZD, due 04/01/24	UBS AG	6 451	12 000	67	0,00
Bought CHF / Sold NZD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	6 455	12 000	96	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold PEN, due 04/01/24	Merrill Lynch International	2 587	11 000	103	0,00
Bought CHF / Sold PEN, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	2 545	11 000	66	0,00
Bought CHF / Sold PLN, due 04/01/24	UBS AG	6 852	31 000	257	0,00
Bought CHF / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	6 718	31 000	128	0,00
Bought CHF / Sold RON, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	3 279	17 000	121	0,00
Bought CHF / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	3 213	17 000	57	0,00
Bought CHF / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	15 557	184 000	226	0,00
Bought CHF / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	15 655	184 000	380	0,00
Bought CHF / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	9 849	15 000	330	0,00
Bought CHF / Sold SGD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	9 658	15 000	124	0,00
Bought CHF / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	14 181	565 000	294	0,00
Bought CHF / Sold THB, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	13 969	565 000	52	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	619 040	708 000	27 507	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 559 928	8 868 834	113 437	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	618 647	708 000	27 041	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	694 698	795 000	30 401	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	9 000	10 258	435	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	619 415	729 000	9 402	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Goldman Sachs International	619 191	729 000	9 134	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	619 789	729 000	9 847	0,00
Bought CNH / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	107 362 000	11 820 103	10 437	0,00
Bought CNH / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	155 000	21 758	11	0,00
Bought CNH / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	10 273 000	1 437 790	5 033	0,00
Bought CNY / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	186 901 000	23 622 114	260 573	0,01
Bought CNY / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	7 120 000	908 215	2 629	0,00
Bought CNY / Sold EUR, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	1 872 000	237 930	1 642	0,00
Bought CNY / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 502 991 000	275 568 755	1 661 083	0,03
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	16 267 000	2 283 518	10 364	0,00
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	1 073 760 000	150 354 967	1 060 717	0,02
Bought COP / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	1 092 423 000	252 951	2 500	0,00
Bought COP / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	6 726 680 000	1 342 677	24 373	0,00
Bought COP / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 134 281 000	542 552	8 265	0,00
Bought CZK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 287 000	294 964	192	0,00
Bought EUR / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 575 798	5 786 000	2 792	0,00
Bought EUR / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	449 078	3 496 000	3 107	0,00
Bought EUR / Sold CNY, due 04/01/24	UBS AG	23 442 263	183 405 000	33 734	0,00
Bought EUR / Sold CZK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	299 404	7 287 000	4 713	0,00
Bought EUR / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	562 538	4 193 000	64	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	197 027	170 000	937	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	351 930	302 000	3 783	0,00
Bought EUR / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	207 518	78 775 000	1 606	0,00
Bought EUR / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 123 250	19 097 502 000	2 442	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold KRW, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	3 113 225	4 419 597 000	7 298	0,00
Bought EUR / Sold PEN, due 04/01/24	Standard Chartered Bank	163 368	667 000	334	0,00
Bought EUR / Sold PEN, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	163 232	667 000	573	0,00
Bought EUR / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	505 437	2 197 000	592	0,00
Bought EUR / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	162 352	809 000	1	0,00
Bought EUR / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 033 371	11 435 000	6 827	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	208 202 232	229 793 141	206 285	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 322 020	8 000 899	87 680	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	203 524 524	224 796 478	35 519	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International Westpac Banking Corporation	36 363 366	39 967 666	202 668	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	410 000	441 985	10 939	0,00
Bought GBP / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	42 512 965	79 163 000	130 564	0,00
Bought GBP / Sold CLP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	14 507	15 928 000	255	0,00
Bought GBP / Sold CLP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	14 447	15 928 000	217	0,00
Bought GBP / Sold CNH, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	158 107	1 428 000	997	0,00
Bought GBP / Sold CNH, due 04/01/24	BNP Paribas SA	11 579 837	104 567 000	75 822	0,00
Bought GBP / Sold CNH, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	151 614	1 367 000	1 285	0,00
Bought GBP / Sold CNY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 532 157	13 808 000	6 076	0,00
Bought GBP / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	274 048 566	2 474 708 000	389 284	0,01
Bought GBP / Sold CNY, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	1 624 698	14 475 000	29 991	0,00
Bought GBP / Sold CZK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	3 732 495	104 843 000	67 301	0,00
Bought GBP / Sold CZK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 679 080	104 843 000	4 883	0,00
Bought GBP / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	5 494 999	47 261 000	1 375	0,00
Bought GBP / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	5 510 524	47 261 000	11 132	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	4 082 303	4 706 000	5 463	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	13 367 499	15 371 137	60 596	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	351 429 141	403 563 045	1 711 923	0,03
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	350 703 699	403 022 000	1 385 398	0,02
Bought GBP / Sold HKD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 351	53 000	34	0,00
Bought GBP / Sold HUF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 407 930	617 145 000	11 469	0,00
Bought GBP / Sold HUF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 394 482	617 145 000	2 409	0,00
Bought GBP / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	12 067 944	236 222 898 000	42 306	0,00
Bought GBP / Sold KRW, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	35 058 776	57 130 030 000	331 146	0,01
Bought GBP / Sold KRW, due 04/01/24	Goldman Sachs International	9 355 518	54 625 000	37 797	0,00
Bought GBP / Sold MYR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 106 083	27 231 000	1 763	0,00
Bought GBP / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	873 780	4 083 000	11 201	0,00
Bought GBP / Sold PEN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 126 289	25 644 000	17 685	0,00
Bought GBP / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 330 734	13 370 000	4 040	0,00
Bought GBP / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	11 647 683	148 338 000	112 579	0,00
Bought GBP / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	437 741 858	554 748 668	3 287 493	0,05
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	37 988 001	48 106 557	320 793	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA				
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	479 184 364	608 051 409	2 815 929	0,04

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	432 000	549 292	1 424	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	58 646 333	74 032 000	730 726	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International Westpac Banking Corporation	427 432 157	542 153 666	2 739 622	0,04
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Corporation	9 225 015	11 517 049	243 061	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC Goldman Sachs International	469 638 482	596 982 332	1 820 649	0,03
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	International	464 070 792	590 533 332	1 170 680	0,02
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	464 432 485	590 533 336	1 631 846	0,02
Bought HKD / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	53 000	5 322	3	0,00
Bought HKD / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	976 000	124 974	20	0,00
Bought HUF / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	78 775 000	205 996	74	0,00
Bought IDR / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	236 222 898 000	12 002 587	41 014	0,00
Bought IDR / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	88 744 375 000	5 723 671	40 017	0,00
Bought ILS / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 380 000	344 352	2 838	0,00
Bought ILS / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	10 825 000	2 344 711	17 171	0,00
Bought ILS / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	5 904 000	1 630 940	8 666	0,00
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 681 000	9 962	87	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC Goldman Sachs International	2 251 472 000	14 292 293	181 565	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	International	2 251 472 000	14 294 153	179 510	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC Westpac Banking Corporation	173 844 000	1 118 086	2 434	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 05/02/24	Corporation	45 691 000	292 890	1 717	0,00
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	31 488 686 500	173 797 806	1 797 128	0,03
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	Merrill Lynch International	31 488 686 500	173 730 685	1 882 695	
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	13 458 019 000	94 431 465	1 029 018	0,02
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	31 344 000	217 744	4 585	0,00
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada JPMorgan Chase Bank NA London	13 061 022 000	91 624 146	1 020 357	0,02
Bought KRW / Sold EUR, due 04/01/24	London	4 419 597 000	3 089 137	19 313	0,00
Bought KRW / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG JPMorgan Chase Bank NA London	57 130 030 000	34 459 669	432 601	0,01
Bought KRW / Sold USD, due 04/01/24	London	25 149 831 000	19 254 933	274 149	0,01
Bought KRW / Sold USD, due 04/01/24	State Street Bank London	31 256 000	23 818	452	0,00
Bought MXN / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	15 484 000	825 089	2 735	0,00
Bought MXN / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	229 413 000	10 611 764	17 030	0,00
Bought MXN / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG Goldman Sachs International	92 171 000	5 437 348	4 602	0,00
Bought MYR / Sold EUR, due 04/01/24	International	4 622 000	904 112	7 175	0,00
Bought MYR / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	54 625 000	9 218 165	137 303	0,00
Bought MYR / Sold USD, due 04/01/24	International	19 899 000	4 261 485	69 368	0,00
Bought NOK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 437 000	217 022	227	0,00
Bought NZD / Sold EUR, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	761 000	435 729	481	0,00
Bought NZD / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	8 937 000	4 435 981	3 442	0,00
Bought NZD / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	4 073 000	2 575 765	3 054	0,00
Bought PEN / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	4 083 000	862 857	2 724	0,00
Bought PEN / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 297 000	349 155	1 126	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought SGD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	739 000	505 100	2 276	0,00
Bought SGD / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	10 770 000	6 388 547	20 877	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	4 363 000	3 301 434	6 279	0,00
Bought THB / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	33 441 000	874 234	14 059	0,00
Bought THB / Sold GBP, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	340 690 000	7 676 656	195 939	0,00
Bought THB / Sold USD, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	153 890 000	4 404 408	104 558	0,00
Bought USD / Sold AUD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	189 085	276 000	554	0,00
Bought USD / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	22 828 142	33 320 000	67 890	0,00
Bought USD / Sold CLP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	180 668	156 360 000	1 965	0,00
Bought USD / Sold CNH, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	1 455 681	10 362 000	358	0,00
Bought USD / Sold CZK, due 04/01/24	UBS AG	2 241 903	49 598 000	22 779	0,00
Bought USD / Sold CZK, due 05/02/24	UBS AG	2 218 908	49 598 000	2 080	0,00
Bought USD / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 996 565	20 143 000	6 740	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	42 558 999	38 505 861	21 866	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	42 165 002	38 141 114	30 802	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	190 000 014	171 692 615	95 253	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	185 067 015	167 160 000	175 662	0,00
Bought USD / Sold HKD, due 04/01/24	UBS AG	125 102	976 000	108	0,00
Bought USD / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	1 191 524	411 206 000	3 259	0,00
Bought USD / Sold HUF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 185 769	411 206 000	2 682	0,00
Bought USD / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	980 430	9 937 000	1 160	0,00
Bought USD / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 172 688	12 438 000	11 055	0,00
Bought USD / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	1 078 816	4 850 000	2 270	0,00
Bought USD / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	5 811 731	58 024 000	46 584	0,00
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				31 695 465	0,48

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	102 000	59 506	(1 100)	(0,00)
Bought AUD / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	7 000	4 068	(68)	(0,00)
Bought AUD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 786 000	3 576 928	(3 201)	(0,00)
Bought AUD / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	79 163 000	42 479 240	(134 202)	(0,00)
Bought AUD / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	276 000	188 902	(567)	(0,00)
Bought AUD / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	33 320 000	22 805 944	(69 311)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	3 000	1 931	(20)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	178 000	114 982	(1 619)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	12 000	7 725	(104)	(0,00)
Bought CHF / Sold COP, due 04/01/24	UBS AG	7 454	34 854 000	(138)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	227 801	38 283 500	(893)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 889	830 000	(78)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	Citibank NA	12 859	2 162 000	(57)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	UBS AG	227 644	38 283 500	(1 080)	(0,00)
Bought CHF / Sold NOK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 186	51 000	(48)	(0,00)
Bought CLP / Sold GBP, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	15 928 000	14 479	(219)	(0,00)
Bought CLP / Sold USD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	156 360 000	181 031	(1 987)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought CNY / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	69 000	8 474	(338)	(0,00)
Bought CNY / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	3 227 000	384 670	(1 990)	(0,00)
Bought CNY / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	218 000	26 238	(441)	(0,00)
Bought COP / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	34 854 000	7 651	(95)	(0,00)
Bought CZK / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	155 000	5 922	(101)	(0,00)
Bought CZK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	104 843 000	3 683 774	(5 192)	(0,00)
Bought CZK / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	49 598 000	2 221 380	(2 256)	(0,00)
Bought DKK / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	68 000	8 608	(150)	(0,00)
Bought DKK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 193 000	562 495	(16)	(0,00)
Bought DKK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	47 261 000	5 502 586	(11 047)	(0,00)
Bought DKK / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	20 143 000	2 991 732	(6 707)	(0,00)
Bought EUR / Sold AUD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	3 488 918	5 786 000	(94 023)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	6 609 003	9 859 000	(176 194)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought EUR / Sold CAD, due 04/01/24	London	312 249	458 000	(2 410)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	7 056 599	10 317 000	(22 881)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	519 000	489 790	(8 605)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	International	498 000	469 664	(7 891)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	1 410 671	1 355 000	(51 576)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 438 998	1 355 000	(23 651)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought EUR / Sold CHF, due 05/02/24	Corporation	70 000	65 960	(1 205)	(0,00)
Bought EUR / Sold CNY, due 05/02/24	UBS AG	23 644 228	186 901 000	(286 396)	(0,01)
Bought EUR / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	242 592	1 092 423 000	(13 943)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold COP, due 05/02/24	International	251 076	1 092 423 000	(2 398)	(0,00)
Bought EUR / Sold CZK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	294 264	7 287 000	(222)	(0,00)
Bought EUR / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	562 681	4 193 000	(0)	(0,00)
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	412 862 509	359 103 314	(1 701 155)	(0,03)
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	International	403 022 000	350 322 844	(1 378 489)	(0,02)
Bought EUR / Sold GBP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	180 000	156 562	(527)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought EUR / Sold GBP, due 05/02/24	Corporation	10 434 215	9 072 379	(26 538)	(0,00)
Bought EUR / Sold HUF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	204 842	78 775 000	(74)	(0,00)
Bought EUR / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	1 119 354	19 097 502 000	(3 785)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	341 902	1 380 000	(5 545)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 05/02/24	BNP Paribas SA	344 100	1 380 000	(2 882)	(0,00)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	525 905	84 524 000	(18 583)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	International	13 952 426	2 251 875 000	(559 870)	(0,01)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	13 414 766	2 166 545 000	(548 558)	(0,01)
Bought EUR / Sold JPY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	14 345 931	2 251 472 000	(180 303)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold JPY, due 05/02/24	International	14 347 897	2 251 472 000	(178 129)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought EUR / Sold KRW, due 05/02/24	London	3 090 433	4 419 597 000	(19 656)	(0,00)
Bought EUR / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	814 609	15 484 000	(14 312)	(0,00)
Bought EUR / Sold MXN, due 06/02/24	UBS AG	819 505	15 484 000	(2 915)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	907 039	4 622 000	(3 941)	(0,00)
Bought EUR / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	904 908	4 622 000	(7 207)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	208 250	2 437 000	(9 917)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	216 917	2 437 000	(235)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	425 814	761 000	(11 433)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	435 228	761 000	(492)	(0,00)
Bought EUR / Sold PLN, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	505 552	2 197 000	(227)	(0,00)
Bought EUR / Sold RON, due 04/01/24	BNP Paribas SA	162 430	809 000	(199)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	1 006 554	11 435 000	(22 779)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	505 173	739 000	(2 196)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	505 180	739 000	(2 299)	(0,00)
Bought EUR / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	872 673	33 441 000	(15 784)	(0,00)
Bought EUR / Sold THB, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	874 874	33 441 000	(14 908)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	38 096 864	42 164 999	(27 044)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Goldman Sachs International	38 085 129	42 164 999	(40 022)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	38 092 013	42 165 002	(32 411)	(0,00)
Bought GBP / Sold AUD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	41 288 999	79 011 000	(1 279 404)	(0,02)
Bought GBP / Sold AUD, due 04/01/24	Citibank NA	79 723	152 000	(2 090)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 988 124	13 670 000	(184 079)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 04/01/24	UBS AG	75 816 101	130 467 000	(2 295 892)	(0,03)
Bought GBP / Sold CAD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	12 950	22 000	(181)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	85 706 047	144 137 000	(85 903)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	3 000	3 320	(120)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	14 863 639	16 477 000	(628 757)	(0,01)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	155 000	168 467	(2 568)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	2 161 531	2 375 000	(66 305)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	17 406 249	18 863 945	(294 141)	(0,01)
Bought GBP / Sold CNH, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	11 844 227	107 362 000	(8 431)	(0,00)
Bought GBP / Sold CNY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	43 869	397 000	(224)	(0,00)
Bought GBP / Sold CNY, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	276 131 171	2 502 991 000	(1 992 981)	(0,03)
Bought GBP / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 303 666	6 726 680 000	(74 106)	(0,00)
Bought GBP / Sold COP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	1 333 991	6 726 680 000	(23 902)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	18 431 660	21 362 000	(101 640)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	21 596 928	25 159 000	(261 052)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	324 854 924	374 906 000	(28 648)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	324 782 193	374 906 000	(121 366)	(0,00)
Bought GBP / Sold HKD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	5 325	53 000	(3)	(0,00)
Bought GBP / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	11 998 319 236	222 898 000	(39 195)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 324 452	10 825 000	(42 995)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 345 454	10 825 000	(17 587)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 970 145	367 048 000	(91 994)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	8 888 581	1 655 596 000	(412 260)	(0,01)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Citibank NA	11 014 660	2 036 898 000	(406 574)	(0,01)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	UBS AG	157 073 752	29 267 159 500	(7 359 315)	(0,12)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	159 078 712	29 650 671 500	(7 523 706)	(0,12)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	52 835	9 610 000	(1 132)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	174 644 133	31 488 686 500	(1 767 564)	(0,03)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	Merrill Lynch International	174 574 421	31 488 686 500	(1 856 450)	(0,03)
Bought GBP / Sold KRW, due 05/02/24	UBS AG	34 509 417	57 130 030 000	(439 617)	(0,01)
Bought GBP / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	10 457 446	229 413 000	(213 755)	(0,00)
Bought GBP / Sold MXN, due 06/02/24	BNP Paribas SA	10 551 717	229 413 000	(19 746)	(0,00)
Bought GBP / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	9 236 089	54 625 000	(137 953)	(0,00)
Bought GBP / Sold NOK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 016 639	27 231 000	(110 595)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	4 333 768	8 937 000	(133 744)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	4 435 687	8 937 000	(3 534)	(0,00)
Bought GBP / Sold PEN, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	861 694	4 083 000	(3 011)	(0,00)
Bought GBP / Sold PLN, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	5 113 937	25 644 000	(2 107)	(0,00)
Bought GBP / Sold RON, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 326 382	13 370 000	(3 050)	(0,00)
Bought GBP / Sold SEK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	11 315 996	148 338 000	(294 088)	(0,01)
Bought GBP / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	6 379 183	10 770 000	(32 816)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	6 396 646	10 770 000	(20 914)	(0,00)
Bought GBP / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	7 748 298	340 690 000	(104 609)	(0,00)
Bought GBP / Sold THB, due 05/02/24	JPMorgan Chase Bank NA London	7 691 648	340 690 000	(203 279)	(0,00)
Bought HUF / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	1 489 000	3 679	(68)	(0,00)
Bought HUF / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	617 145 000	1 400 797	(2 376)	(0,00)
Bought HUF / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	411 206 000	1 190 947	(2 681)	(0,00)
Bought IDR / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	380 416 000	21 226	(513)	(0,00)
Bought IDR / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	19 097 502 000	1 124 971	(2 419)	(0,00)
Bought ILS / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	26 000	6 123	(55)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	38 939 000	232 987	(620)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	38 939 000	233 010	(647)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	5 323 000	31 987	(191)	(0,00)
Bought JPY / Sold GBP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	13 796 000	77 177	(68)	(0,00)
Bought KRW / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	78 929 000	52 273	(818)	(0,00)
Bought MXN / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	273 000	13 731	(196)	(0,00)
Bought MYR / Sold CHF, due 04/01/24	Goldman Sachs International	71 000	13 154	(176)	(0,00)
Bought NOK / Sold CHF, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	51 000	4 287	(71)	(0,00)
Bought NOK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	27 231 000	2 104 768	(1 751)	(0,00)
Bought NOK / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	9 937 000	979 653	(1 162)	(0,00)
Bought NZD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	12 000	6 476	(96)	(0,00)
Bought PEN / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	11 000	2 557	(67)	(0,00)
Bought PEN / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	667 000	163 635	(629)	(0,00)
Bought PLN / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	31 000	6 743	(128)	(0,00)
Bought PLN / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 197 000	506 452	(767)	(0,00)
Bought PLN / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	25 644 000	5 131 582	(20 387)	(0,00)
Bought PLN / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	12 438 000	3 174 007	(10 967)	(0,00)
Bought RON / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	17 000	3 225	(57)	(0,00)
Bought RON / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	809 000	162 629	(20)	(0,00)
Bought RON / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	13 370 000	2 332 265	(4 450)	(0,00)
Bought RON / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	4 850 000	1 079 277	(2 361)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought SEK / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	184 000	15 687	(380)	(0,00)
Bought SEK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	11 435 000	1 033 383	(6 858)	(0,00)
Bought SEK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	148 338 000	11 634 908	(112 464)	(0,00)
Bought SEK / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	58 024 000	5 804 358	(46 554)	(0,00)
Bought SGD / Sold CHF, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	15 000	9 675	(124)	(0,00)
Bought THB / Sold CHF, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	565 000	13 987	(65)	(0,00)
Bought USD / Sold AUD, due 04/01/24	Morgan Stanley And Co International	210 134	317 000	(6 178)	(0,00)
Bought USD / Sold AUD, due 04/01/24	UBS AG	22 109 253	33 320 000	(627 380)	(0,01)
Bought USD / Sold CAD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	405 549	550 000	(11 574)	(0,00)
Bought USD / Sold CAD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	41 763 947	56 648 000	(1 198 146)	(0,02)
Bought USD / Sold CAD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 011 068	2 723 000	(54 068)	(0,00)
Bought USD / Sold CAD, due 05/02/24	Bank of Montreal	44 984 283	59 354 000	(50 442)	(0,00)
Bought USD / Sold CAD, due 05/02/24	Goldman Sachs International	374 336	494 000	(486)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	776 000	662 714	(11 398)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	8 645 360	7 549 000	(323 926)	(0,01)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Goldman Sachs International	729 000	621 254	(9 138)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	729 000	621 837	(9 831)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	9 028 133	7 671 135	(116 592)	(0,00)
Bought USD / Sold CLP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	177 844	156 360 000	(1 201)	(0,00)
Bought USD / Sold CNH, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	9 248	66 000	(21)	(0,00)
Bought USD / Sold CNH, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	1 258 859	8 970 000	(3 582)	(0,00)
Bought USD / Sold CNY, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	152 127 047	1 082 889 000	(575 959)	(0,01)
Bought USD / Sold CNY, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	1 000 224	7 138 000	(6 338)	(0,00)
Bought USD / Sold CNY, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	150 692 583	1 073 760 000	(1 199 490)	(0,02)
Bought USD / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	516 876	2 134 281 000	(33 941)	(0,00)
Bought USD / Sold COP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	539 156	2 134 281 000	(8 093)	(0,00)
Bought USD / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 972 536	20 143 000	(12 489)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	179 000	163 321	(1 420)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	223 918 872	203 502 713	(889 030)	(0,02)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	191 637 151	174 483 500	(1 113 447)	(0,01)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	294 000	270 041	(4 313)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	1 313 000	1 190 209	(3 459)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	590 533 332	464 669 656	(1 830 561)	(0,03)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Citibank NA	2 426 449	1 922 000	(23 729)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	654 824 665	514 835 592	(1 491 088)	(0,03)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	590 533 336	464 511 394	(1 628 804)	(0,02)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	614 466	484 000	(2 541)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	22 000	17 331	(93)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	413 000	326 162	(2 866)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 05/02/24	Goldman Sachs International	65 909 500	51 795 000	(130 660)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	549 381	432 000	(1 432)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	175 000	137 575	(413)	(0,00)
Bought USD / Sold HKD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	125 062	976 000	(23)	(0,00)
Bought USD / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	5 680 633 88 744 375 000		(83 056)	(0,00)
Bought USD / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	5 722 932 88 744 375 000		(39 034)	(0,00)
Bought USD / Sold ILS, due 04/01/24	UBS AG	1 609 426	5 904 000	(30 180)	(0,00)
Bought USD / Sold ILS, due 05/02/24	UBS AG	1 632 292	5 904 000	(8 344)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	87 998 913 12 915 512 500		(3 613 461)	(0,05)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	87 964 931 12 915 512 500		(3 647 444)	(0,06)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	4 911 983	719 360 000	(190 584)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	92 194 907 13 061 022 000		(901 010)	(0,01)
Bought USD / Sold JPY, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	92 084 731 13 061 022 000		(1 011 186)	(0,02)
Bought USD / Sold KRW, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	19 355 922 25 181 087 000		(197 430)	(0,00)
Bought USD / Sold KRW, due 05/02/24	JPMorgan Chase Bank NA London	19 287 272 25 149 831 000		(276 207)	(0,01)
Bought USD / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 334 167	92 171 000	(107 783)	(0,00)
Bought USD / Sold MXN, due 06/02/24	UBS AG	5 407 763	92 171 000	(5 495)	(0,00)
Bought USD / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	4 270 630	19 899 000	(60 223)	(0,00)
Bought USD / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	4 270 630	19 899 000	(69 534)	(0,00)
Bought USD / Sold NOK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	934 068	9 937 000	(44 422)	(0,00)
Bought USD / Sold NZD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 504 345	4 073 000	(74 474)	(0,00)
Bought USD / Sold NZD, due 05/02/24	UBS AG	2 576 168	4 073 000	(2 973)	(0,00)
Bought USD / Sold PEN, due 04/01/24	Standard Chartered Bank	345 747	1 297 000	(4 536)	(0,00)
Bought USD / Sold PEN, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	348 769	1 297 000	(1 194)	(0,00)
Bought USD / Sold PLN, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	3 148 200	12 438 000	(14 840)	(0,00)
Bought USD / Sold RON, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 071 204	4 850 000	(5 712)	(0,00)
Bought USD / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	5 617 961	58 024 000	(139 844)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	3 280 397	4 363 000	(27 316)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 05/02/24	UBS AG	3 306 232	4 363 000	(6 256)	(0,00)
Bought USD / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	4 384 343	153 890 000	(124 622)	(0,00)
Bought USD / Sold THB, due 05/02/24	JPMorgan Chase Bank NA London	4 413 565	153 890 000	(108 122)	(0,00)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(56 859 838)	(0,85)
Total des contrats de change à terme – couverture				(25 164 373)	(0,37)
Autres actifs/(passifs) nets				144 483 634	2,16
TOTAL DES ACTIFS NETS				6 675 453 368	100,00

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en yens japonais)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,15 %				Actions ordinaires et préférentielles – 98,15 % (<i>suite</i>)			
Japon				Japon (<i>suite</i>)			
37 600	JPY Advantest Corp	180 367 200	0,71	17 300	JPY Hoya Corp	304 912 500	1,19
31 800	JPY Aeon Co Ltd	100 201 800	0,39	20 300	JPY Hulic Co Ltd	29 972 950	0,12
9 600	JPY AGC Inc	50 265 600	0,20	5 600	JPY Ibiden Co Ltd	43 764 000	0,17
7 000	JPY Aisin Corp	34 531 000	0,14	46 150	JPY Idemitsu Kosan Co Ltd	35 420 125	0,14
21 300	JPY Ajinomoto Co Inc	115 872 000	0,45	8 600	JPY Iida Group Holdings Co Ltd	18 158 900	0,07
7 200	JPY ANA Holdings Inc	22 032 000	0,09	49 200	JPY Inpex Corp	93 701 400	0,37
23 900	JPY Asahi Group Holdings Ltd	125 666 200	0,49	29 700	JPY Isuzu Motors Ltd	53 935 200	0,21
11 200	JPY Asahi Intecc Co Ltd	32 127 200	0,13	58 700	JPY Itochu Corp	338 522 900	1,33
61 300	JPY Asahi Kasei Corp	63 690 700	0,25	6 900	JPY Japan Airlines Co Ltd	19 147 500	0,07
89 400	JPY Astellas Pharma Inc	150 728 400	0,59	24 100	JPY Japan Exchange Group Inc	71 890 300	0,28
6 100	JPY Azbil Corp	28 462 600	0,11	359	JPY Japan Metropolitan Fund Invest REIT	36 582 100	0,14
28 800	JPY Bandai Namco Holdings Inc	81 403 200	0,32	71 800	JPY Japan Post Bank Co Ltd	103 104 800	0,40
6 400	JPY BayCurrent Consulting Inc	31 686 400	0,12	100 500	JPY Japan Post Holdings Co Ltd	126 579 750	0,50
28 200	JPY Bridgestone Corp	164 688 000	0,64	9 200	JPY Japan Post Insurance Co Ltd	23 036 800	0,09
11 200	JPY Brother Industries Ltd	25 205 600	0,10	61	JPY Japan Real Estate Investment Corp REIT	35 624 000	0,14
49 100	JPY Canon Inc	177 742 000	0,70	60 100	JPY Japan Tobacco Inc	219 064 500	0,86
8 800	JPY Capcom Co Ltd	40 092 800	0,16	28 100	JPY JFE Holdings Inc	61 468 750	0,24
35 900	JPY Central Japan Railway Co	128 665 600	0,50	7 900	JPY JSR Corp	31 758 000	0,12
27 600	JPY Chiba Bank Ltd	28 110 600	0,11	21 700	JPY Kajima Corp	51 136 050	0,20
29 700	JPY Chubu Electric Power Co Inc	54 098 550	0,21	35 100	JPY Kansai Electric Power Co Inc	65 707 200	0,26
33 000	JPY Chugai Pharmaceutical Co Ltd	176 286 000	0,69	22 500	JPY Kao Corp	130 500 000	0,51
51 100	JPY Concordia Financial Group Ltd	32 939 060	0,13	7 100	JPY Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	42 955 000	0,17
10 500	JPY Dai Nippon Printing Co Ltd	43 816 500	0,17	73 800	JPY KDDI Corp	331 066 800	1,30
15 500	JPY Daifuku Co Ltd	44 213 750	0,17	211	JPY KDX Realty Investment Corp REIT	33 928 800	0,13
46 600	JPY Dai-ichi Life Holdings Inc	139 427 200	0,55	6 200	JPY Keisei Electric Railway Co Ltd	41 316 800	0,16
90 400	JPY Daiichi Sankyo Co Ltd	350 028 800	1,37	9 600	JPY Keyence Corp	596 352 000	2,34
12 900	JPY Daikin Industries Ltd	296 506 500	1,16	6 800	JPY Kikkoman Corp	58 711 200	0,23
3 000	JPY Daito Trust Construction Co Ltd	49 050 000	0,19	8 600	JPY Kintetsu Group Holdings Co Ltd	38 459 200	0,15
29 000	JPY Daiwa House Industry Co Ltd	123 888 000	0,49	38 800	JPY Kirin Holdings Co Ltd	80 160 800	0,31
121	JPY Daiwa House Investment Corp REIT	30 455 700	0,12	7 700	JPY Kobe Bussan Co Ltd	32 078 200	0,13
64 000	JPY Daiwa Securities Group Inc	60 742 400	0,24	6 900	JPY Koei Tecmo Holdings Co Ltd	11 098 650	0,04
85 200	JPY Denso Corp	181 220 400	0,71	9 900	JPY Koito Manufacturing Co Ltd	21 755 250	0,08
9 100	JPY Dentsu Group Inc	32 923 800	0,13	45 400	JPY Komatsu Ltd	167 435 200	0,66
4 600	JPY Disco Corp	160 908 000	0,63	5 100	JPY Konami Group Corp	37 653 300	0,15
15 100	JPY East Japan Railway Co	122 747 900	0,48	1 600	JPY Kose Corp	16 920 000	0,07
12 900	JPY Eisai Co Ltd	90 970 800	0,36	49 000	JPY Kubota Corp	104 002 500	0,41
144 100	JPY ENEOS Holdings Inc	80 753 640	0,32	61 600	JPY Kyocera Corp	126 772 800	0,50
46 775	JPY FANUC Corp	193 975 925	0,76	12 900	JPY Kyowa Kirin Co Ltd	30 573 000	0,12
8 500	JPY Fast Retailing Co Ltd	297 415 000	1,16	3 700	JPY Lasertec Corp	137 529 000	0,54
5 800	JPY Fuji Electric Co Ltd	35 200 200	0,14	128 200	JPY LY Corp	64 061 540	0,25
18 420	JPY Fujifilm Holdings Corp	156 072 660	0,61	21 400	JPY M3 Inc	49 926 200	0,20
8 600	JPY Fujitsu Ltd	182 965 000	0,72	11 300	JPY Makita Corp	43 957 000	0,17
214	JPY GLP J-Reit REIT	30 067 000	0,12	70 800	JPY Marubeni Corp	157 777 800	0,62
6 800	JPY Hamamatsu Photonics KK	39 440 000	0,15	16 500	JPY MatsukiyoCocokara & Co	41 200 500	0,16
11 000	JPY Hankyu Hanshin Holdings Inc	49 379 000	0,19	28 600	JPY Mazda Motor Corp	43 572 100	0,17
1 000	JPY Hikari Tsushin Inc	23 380 000	0,09	4 100	JPY McDonald's Holdings Co Japan Ltd	25 051 000	0,10
1 640	JPY Hirose Electric Co Ltd	26 182 600	0,10	11 900	JPY MEIJI Holdings Co Ltd	39 853 100	0,16
5 700	JPY Hitachi Construction Machinery Co Ltd	21 243 900	0,08	17 400	JPY MINEBEA MITSUMI Inc	50 433 900	0,20
45 314	JPY Hitachi Ltd	460 843 380	1,81	14 700	JPY MISUMI Group Inc	35 125 650	0,14
225 200	JPY Honda Motor Co Ltd	330 143 200	1,29	62 500	JPY Mitsubishi Chemical Group Corp	54 000 000	0,21
5 700	JPY Hoshizaki Corp	29 417 700	0,11				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en yens japonais)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,15 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,15 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
168 600	JPY Mitsubishi Corp	379 940 100	1,49	20 800	JPY Otsuka Holdings Co Ltd	110 011 200	0,43
94 800	JPY Mitsubishi Electric Corp	189 505 200	0,74	19 100	JPY Pan Pacific International Holdings Corp	64 252 400	0,25
55 000	JPY Mitsubishi Estate Co Ltd	106 865 000	0,42	107 640	JPY Panasonic Holdings Corp	150 319 260	0,59
38 600	JPY Mitsubishi HC Capital Inc	36 546 480	0,14	75 992	JPY Rakuten Group Inc	47 722 976	0,19
15 900	JPY Mitsubishi Heavy Industries Ltd	131 031 900	0,51	70 400	JPY Recruit Holdings Co Ltd	419 795 200	1,64
558 200	JPY Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	676 259 300	2,65	70 900	JPY Renesas Electronics Corp	180 724 100	0,71
63 900	JPY Mitsui & Co Ltd	338 542 200	1,33	102 300	JPY Resona Holdings Inc	73 297 950	0,29
8 220	JPY Mitsui Chemicals Inc	34 376 040	0,13	26 400	JPY Ricoh Co Ltd	28 591 200	0,11
42 700	JPY Mitsui Fudosan Co Ltd	147 656 600	0,58	16 200	JPY Rohm Co Ltd	43 780 500	0,17
16 900	JPY Mitsui OSK Lines Ltd	76 337 300	0,30	12 542	JPY SBI Holdings Inc	39 783 224	0,16
117 879	JPY Mizuho Financial Group Inc	284 383 088	1,11	7 500	JPY SCSK Corp	20 970 000	0,08
13 100	JPY MonotaRO Co Ltd	20 167 450	0,08	10 100	JPY Secom Co Ltd	102 565 500	0,40
20 600	JPY MS&AD Insurance Group Holdings Inc	114 247 600	0,45	13 800	JPY Seiko Epson Corp	29 124 900	0,11
84 200	JPY Murata Manufacturing Co Ltd	252 010 600	0,99	19 500	JPY Sekisui Chemical Co Ltd	39 633 750	0,16
12 000	JPY NEC Corp	100 200 000	0,39	28 600	JPY Sekisui House Ltd	89 575 200	0,35
17 500	JPY Nexon Co Ltd	44 966 250	0,18	36 900	JPY Seven & i Holdings Co Ltd	206 455 500	0,81
20 700	JPY Nidec Corp	117 886 500	0,46	14 200	JPY SG Holdings Co Ltd	28 740 800	0,11
50 600	JPY Nintendo Co Ltd	372 365 400	1,46	12 500	JPY Sharp Corp	12 568 750	0,05
73	JPY Nippon Building Fund Inc REIT	44 603 000	0,17	11 500	JPY Shimadzu Corp	45 333 000	0,18
3 500	JPY Nippon Express Holdings Inc	28 049 000	0,11	3 800	JPY Shimano Inc	82 973 000	0,32
48 000	JPY Nippon Paint Holdings Co Ltd	54 720 000	0,21	27 100	JPY Shimizu Corp	25 381 860	0,10
118	JPY Nippon Prologis Inc REIT	32 025 200	0,13	88 700	JPY Shin-Etsu Chemical Co Ltd	524 837 900	2,06
8 900	JPY Nippon Sanso Holdings Corp	33 606 400	0,13	13 000	JPY Shionogi & Co Ltd	88 374 000	0,35
41 000	JPY Nippon Steel Corp	132 430 000	0,52	20 000	JPY Shiseido Co Ltd	85 040 000	0,33
1 497 000	JPY Nippon Telegraph & Telephone Corp	257 933 100	1,01	24 400	JPY Shizuoka Financial Group Inc	29 158 000	0,11
23 700	JPY Nippon Yusen KK	103 592 700	0,41	2 800	JPY SMC Corp	212 128 000	0,83
6 500	JPY Nissan Chemical Corp	35 789 000	0,14	140 400	JPY Softbank Corp	247 033 800	0,97
113 300	JPY Nissan Motor Co Ltd	62 790 860	0,25	50 200	JPY SoftBank Group Corp	315 908 600	1,24
9 600	JPY Nissin Foods Holdings Co Ltd	47 241 600	0,18	14 700	JPY Sampo Holdings Inc	101 371 200	0,40
3 900	JPY Nitori Holdings Co Ltd	73 632 000	0,29	61 600	JPY Sony Group Corp	826 056 000	3,24
6 855	JPY Nitto Denko Corp	72 320 250	0,28	4 600	JPY Square Enix Holdings Co Ltd	23 289 800	0,09
149 700	JPY Nomura Holdings Inc	95 463 690	0,37	29 600	JPY Subaru Corp	76 545 600	0,30
5 400	JPY Nomura Real Estate Holdings Inc	20 028 600	0,08	16 900	JPY SUMCO Corp	35 735 050	0,14
204	JPY Nomura Real Estate Master Fund Inc REIT	33 660 000	0,13	75 200	JPY Sumitomo Chemical Co Ltd	25 868 800	0,10
18 500	JPY Nomura Research Institute Ltd	75 868 500	0,30	51 300	JPY Sumitomo Corp	157 798 800	0,62
31 600	JPY NTT Data Group Corp	63 168 400	0,25	35 800	JPY Sumitomo Electric Industries Ltd	64 278 900	0,25
29 900	JPY Obayashi Corp	36 478 000	0,14	12 400	JPY Sumitomo Metal Mining Co Ltd	52 650 400	0,21
3 400	JPY Obic Co Ltd	82 603 000	0,32	62 100	JPY Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	427 248 000	1,67
15 100	JPY Odakyu Electric Railway Co Ltd	32 480 100	0,13	32 798	JPY Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	88 751 388	0,35
40 700	JPY Oji Holdings Corp	22 100 100	0,09	13 900	JPY Sumitomo Realty & Development Co Ltd	58 296 600	0,23
59 500	JPY Olympus Corp	121 409 750	0,48	6 200	JPY Suntory Beverage & Food Ltd	28 830 000	0,11
8 300	JPY Omron Corp	54 638 900	0,21	18 300	JPY Suzuki Motor Corp	110 403 900	0,43
18 800	JPY Ono Pharmaceutical Co Ltd	47 300 800	0,19	8 100	JPY Sysmex Corp	63 649 800	0,25
3 800	JPY Open House Group Co Ltd	15 895 400	0,06	25 500	JPY T&D Holdings Inc	57 132 750	0,22
1 700	JPY Oracle Corp Japan	18 479 000	0,07	8 100	JPY Taisei Corp	39 058 200	0,15
53 800	JPY Oriental Land Co Ltd	282 503 800	1,11	78 481	JPY Takeda Pharmaceutical Co Ltd	318 161 974	1,25
56 400	JPY ORIX Corp	149 798 400	0,59	19 200	JPY TDK Corp	128 966 400	0,51
18 900	JPY Osaka Gas Co Ltd	55 660 500	0,22	33 100	JPY Terumo Corp	152 988 200	0,60
5 500	JPY Otsuka Corp	31 971 500	0,13	11 100	JPY TIS Inc	34 487 700	0,13

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en yens japonais)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,15 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,15 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
8 700	JPY Tobu Railway Co Ltd	32 964 300	0,13	10 500	JPY West Japan Railway Co	61 750 500	0,24
4 900	JPY Toho Co Ltd	23 368 100	0,09	12 900	JPY Yakult Honsha Co Ltd	40 854 300	0,16
88 200	JPY Tokio Marine Holdings Inc	311 257 800	1,22	6 800	JPY Yamaha Corp	22 147 600	0,09
23 200	JPY Tokyo Electron Ltd	585 916 000	2,30	43 500	JPY Yamaha Motor Co Ltd	54 788 250	0,21
18 000	JPY Tokyo Gas Co Ltd	58 284 000	0,23	12 200	JPY Yamato Holdings Co Ltd	31 787 100	0,12
22 600	JPY Tokyu Corp	38 894 600	0,15	12 000	JPY Yaskawa Electric Corp	70 680 000	0,28
11 800	JPY TOPPAN Holdings Inc	46 433 000	0,18	11 000	JPY Yokogawa Electric Corp	29 579 000	0,12
66 500	JPY Toray Industries Inc	48 751 150	0,19	4 500	JPY Zensho Holdings Co Ltd	33 250 500	0,13
14 000	JPY Tosoh Corp	25 214 000	0,10	6 600	JPY ZOZO Inc	20 955 000	0,08
6 400	JPY TOTO Ltd	23 763 200	0,09	Japon – Total			98,15
7 300	JPY Toyota Industries Corp	83 950 000	0,33	Total des actions ordinaires et préférentielles			98,15
520 200	JPY Toyota Motor Corp	1 347 578 100	5,28	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
10 400	JPY Toyota Tsusho Corp	86 403 200	0,34	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			98,15
6 500	JPY Trend Micro Inc	49 062 000	0,19	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			98,15
20 100	JPY Unicharm Corp	102 469 800	0,40				
9 800	JPY USS Co Ltd	27 792 800	0,11				

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,01 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
TOPIX INDEX FUTURE, due 07/03/24	JPY	20	473 200 000	3 770 650	0,01
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			473 200 000	3 770 650	0,01
Total des contrats à terme standardisés			473 200 000	3 770 650	0,01
Autres actifs/(passifs) nets				468 881 135	1,84
TOTAL DES ACTIFS NETS				25 523 681 155	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 15 745 402 JPY détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en francs suisses)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>					
Actions ordinaires et préférentielles – 99,95 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,95 % <i>(suite)</i>					
Suisse				Suisse <i>(suite)</i>					
258 547	CHF ABB Ltd	9 643 803	4,40	113 235	CHF Roche Holding AG	27 685 957	12,63		
25 924	CHF Adecco Group AG	1 069 883	0,49	5 132	CHF Roche Holding AG	1 341 505	0,61		
80 478	CHF Alcon Inc	5 282 576	2,41	66 489	CHF Sandoz Group AG	1 799 192	0,82		
14 963	CHF Avolta AG	494 976	0,23	6 611	CHF Schindler Holding AG	1 390 293	0,63		
5 411	CHF Bachem Holding AG	351 715	0,16	3 764	CHF Schindler Holding AG	750 918	0,34		
7 398	CHF Baloise Holding AG	975 056	0,45	24 037	CHF SGS SA	1 743 644	0,80		
4 829	CHF Banque Cantonale Vaudoise	523 947	0,24	49 040	CHF SIG Group AG	948 924	0,43		
572	CHF Barry Callebaut AG	811 668	0,37	24 452	CHF Sika AG	6 692 512	3,05		
3 427	CHF BKW AG	512 337	0,23	8 156	CHF Sonova Holding AG	2 238 006	1,02		
157	CHF Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG	1 584 130	0,72	17 858	CHF Straumann Holding AG	2 421 545	1,11		
17	CHF Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG	1 734 000	0,79	4 731	CHF Swatch Group AG	1 081 507	0,49		
84 332	CHF Cie Financiere Richemont SA	9 761 429	4,45	8 436	CHF Swatch Group AG	371 606	0,17		
34 593	CHF Clariant AG	429 645	0,20	4 763	CHF Swiss Life Holding AG	2 781 592	1,27		
1 139	CHF EMS-Chemie Holding AG	775 659	0,35	12 303	CHF Swiss Prime Site AG	1 105 425	0,50		
5 380	CHF Geberit AG	2 899 820	1,32	48 275	CHF Swiss Re AG	4 564 884	2,08		
1 488	CHF Givaudan SA	5 184 192	2,37	4 155	CHF Swisscom AG	2 102 430	0,96		
5 985	CHF Helvetia Holding AG	693 662	0,32	10 289	CHF Temenos AG	804 806	0,37		
84 006	CHF Holcim AG	5 546 076	2,53	529 304	CHF UBS Group AG	13 814 834	6,30		
84 006	CHF Holcim AG	5 546 076	2,53	4 339	CHF VAT Group AG	1 828 889	0,84		
33 548	CHF Julius Baer Group Ltd	1 581 788	0,72	23 644	CHF Zurich Insurance Group AG	10 393 902	4,74		
8 756	CHF Kuehne & Nagel International AG	2 537 489	1,16	Suisse – Total			219 113 128	99,95	
26 954	CHF Logitech International SA	2 149 851	0,98	Total des actions ordinaires et préférentielles			219 113 128	99,95	
12 092	CHF Lonza Group AG	4 276 940	1,95	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				219 113 128	99,95
430 337	CHF Nestle SA	41 962 161	19,14	TOTAL DES INVESTISSEMENTS				219 113 128	99,95
330 365	CHF Novartis AG	28 038 078	12,79						
3 652	CHF Partners Group Holding AG	4 429 876	2,02						

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – (0,00) %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Moins-values latentes	% des actifs nets
SWISS MARKET INDEX FUTURE, due 15/03/24	CHF	1	110 810	(960)	(0,00)
Moins-values latentes sur contrats à terme standardisés			110 810	(960)	(0,00)
Total des contrats à terme standardisés			110 810	(960)	(0,00)
Autres actifs/(passifs) nets				114 894	0,05
TOTAL DES ACTIFS NETS				219 227 062	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 8 058 CHF détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en livres sterling)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)					
Actions ordinaires et préférentielles – 99,42 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,42 % (<i>suite</i>)					
Chili				Royaume-Uni (<i>suite</i>)					
19 879	GBP Antofagasta PLC	333 868	0,35	69 754	GBP Informa PLC	544 918	0,57		
Chili – Total				8 334	GBP InterContinental Hotels Group PLC	590 881	0,62		
Irlande				8 136	GBP Intertek Group PLC	345 455	0,36		
35 666	GBP CRH PLC	1 929 531	2,03	82 008	GBP J Sainsbury PLC	248 156	0,26		
4 849	GBP DCC PLC	280 175	0,30	132 123	GBP JD Sports Fashion PLC	219 258	0,23		
Irlande – Total				99 304	GBP Kingfisher PLC	241 607	0,25		
Ile de Man				36 868	GBP Land Securities Group PLC REIT	259 846	0,27		
31 694	GBP Entain PLC	315 102	0,33	301 384	GBP Legal & General Group PLC	756 775	0,80		
Ile de Man – Total				3 203 410	GBP Lloyds Banking Group PLC	1 528 347	1,61		
Jordanie				20 994	GBP London Stock Exchange Group PLC	1 946 984	2,05		
8 174	GBP Hikma Pharmaceuticals PLC	146 233	0,15	109 242	GBP M&G PLC	242 954	0,26		
Jordanie – Total				67 032	GBP Melrose Industries PLC	380 340	0,40		
Afrique du Sud				182 121	GBP National Grid PLC	1 926 840	2,03		
23 922	GBP Mondi PLC	367 801	0,39	288 299	GBP NatWest Group PLC	632 528	0,67		
Afrique du Sud – Total				6 072	GBP Next PLC	492 925	0,52		
Suisse				29 205	GBP Ocado Group PLC	221 491	0,23		
11 534	GBP Coca-Cola HBC AG	265 858	0,28	32 521	GBP Pearson PLC	313 567	0,33		
527 671	GBP Glencore PLC	2 491 135	2,63	16 039	GBP Persimmon PLC	222 782	0,24		
Suisse – Total				36 968	GBP Phoenix Group Holdings PLC	197 853	0,21		
Royaume-Uni				138 791	GBP Prudential PLC	1 231 354	1,30		
49 067	GBP 3i Group PLC	1 187 912	1,25	36 175	GBP Reckitt Benckiser Group PLC	1 960 685	2,07		
98 606	GBP abrdn PLC	176 160	0,19	95 245	GBP RELX PLC	2 962 119	3,12		
13 402	GBP Admiral Group PLC	359 710	0,38	129 778	GBP Rentokil Initial PLC	572 061	0,60		
64 057	GBP Anglo American PLC	1 262 307	1,33	56 762	GBP Rio Tinto PLC	3 316 036	3,50		
22 074	GBP Ashtead Group PLC	1 205 682	1,27	424 291	GBP Rolls-Royce Holdings PLC	1 271 600	1,34		
17 375	GBP Associated British Foods PLC	411 266	0,43	51 368	GBP Sage Group PLC	602 290	0,64		
78 132	GBP Astrazeneca PLC	8 281 992	8,73	42 735	GBP Schroders PLC	183 718	0,19		
45 102	GBP Auto Trader Group PLC	325 366	0,34	58 790	GBP Segro PLC REIT	521 115	0,55		
138 048	GBP Aviva PLC	600 095	0,63	13 568	GBP Severn Trent PLC	349 919	0,37		
153 284	GBP BAE Systems PLC	1 702 219	1,80	333 578	GBP Shell PLC	8 577 958	9,05		
761 508	GBP Barclays PLC	1 171 047	1,24	44 028	GBP Smith & Nephew PLC	474 842	0,50		
48 299	GBP Barratt Developments PLC	271 730	0,29	17 656	GBP Smiths Group PLC	311 364	0,33		
5 266	GBP Berkeley Group Holdings PLC	246 870	0,26	3 796	GBP Spirax-Sarco Engineering PLC	398 770	0,42		
860 329	GBP BP PLC	4 010 424	4,23	55 055	GBP SSE PLC	1 021 821	1,08		
107 101	GBP British American Tobacco PLC	2 458 503	2,59	28 458	GBP St James's Place PLC	194 539	0,21		
333 417	GBP BT Group PLC	412 103	0,43	115 527	GBP Standard Chartered PLC	770 103	0,81		
17 037	GBP Bunzl PLC	543 480	0,57	174 800	GBP Taylor Wimpey PLC	257 043	0,27		
18 995	GBP Burberry Group PLC	268 969	0,28	358 238	GBP Tesco PLC	1 040 681	1,10		
280 386	GBP Centrica PLC	394 363	0,42	126 048	GBP Unilever PLC	4 789 824	5,05		
86 404	GBP Compass Group PLC	1 854 230	1,96	33 619	GBP United Utilities Group PLC	356 193	0,38		
7 039	GBP Croda International PLC	355 469	0,38	1 160 229	GBP Vodafone Group PLC	795 453	0,84		
113 320	GBP Diageo PLC	3 236 419	3,41	9 528	GBP Whitbread PLC	348 344	0,37		
9 436	GBP Endeavour Mining PLC	165 790	0,17	30 097	GBP Wise PLC	263 048	0,28		
46 367	GBP Experian PLC	1 484 671	1,57	54 183	GBP Wpp PLC	407 998	0,43		
206 433	GBP GSK PLC	2 993 691	3,16	Royaume-Uni – Total			88 150 540	92,96	
279 312	GBP Haleon PLC	898 407	0,95	Total des actions ordinaires et préférentielles			94 280 243	99,42	
19 138	GBP Halma PLC	437 112	0,46	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				94 280 243	99,42
16 935	GBP Hargreaves Lansdown PLC	124 303	0,13	TOTAL DES INVESTISSEMENTS				94 280 243	99,42
982 280	GBP HSBC Holdings PLC	6 242 389	6,58						
42 927	GBP Imperial Brands PLC	775 476	0,82						

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en livres sterling)

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,01 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
FTSE 100 INDEX FUTURE, due 15/03/24	GBP	7	542 955	12 130	0,01
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			542 955	12 130	0,01
Total des contrats à terme standardisés			542 955	12 130	0,01
Autres actifs/(passifs) nets				536 014	0,57
TOTAL DES ACTIFS NETS				94 828 387	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 14 896 GBP détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % <i>(suite)</i>			
Argentine				États-Unis <i>(suite)</i>			
1 700	USD MercadoLibre Inc	2 671 618	0,17	67 483	USD AbbVie Inc	10 457 841	0,65
Argentine – Total				17 363	USD Adobe Inc	10 358 766	0,65
Australie				61 745	USD Advanced Micro Devices Inc	9 101 830	0,57
6 100	USD Atlassian Corp	1 450 946	0,09	4 200	USD AECOM	388 206	0,02
Australie – Total				28 939	USD AES Corp	557 076	0,03
Bermudes				22 904	USD Aflac Inc	1 889 580	0,12
14 684	USD Arch Capital Group Ltd	1 090 581	0,07	10 374	USD Agilent Technologies Inc	1 442 297	0,09
1 643	USD Everest Group Ltd	580 932	0,03	8 654	USD Air Products and Chemicals Inc	2 369 465	0,15
9 600	USD Liberty Global Ltd	178 944	0,01	15 500	USD Airbnb Inc	2 110 170	0,13
Bermudes – Total				4 417	USD Akamai Technologies Inc	522 752	0,03
Canada				4 228	USD Albemarle Corp	610 861	0,04
4 167	USD Lululemon Athletica Inc	2 130 545	0,13	16 000	USD Albertsons Cos Inc	368 000	0,02
8 900	USD Ovintiv Inc	390 888	0,03	6 400	USD Alexandria Real Estate Equities Inc REIT	811 328	0,05
10 000	USD Waste Connections Inc	1 492 700	0,09	2 200	USD Align Technology Inc	602 800	0,04
Canada – Total				10 482	USD Alliant Energy Corp	537 727	0,03
Irlande				9 185	USD Allstate Corp	1 285 716	0,08
23 985	USD Accenture PLC	8 416 576	0,52	7 567	USD Ally Financial Inc	264 240	0,02
3 700	USD Allegion PLC	468 753	0,03	5 000	USD Alnylam Pharmaceuticals Inc	957 050	0,06
2 391	USD Jazz Pharmaceuticals PLC	294 093	0,02	199 510	USD Alphabet Inc	28 116 944	1,75
27 433	USD Johnson Controls International PLC	1 581 238	0,10	226 740	USD Alphabet Inc	31 673 311	1,97
52 823	USD Medtronic PLC	4 351 559	0,27	67 845	USD Altria Group Inc	2 736 867	0,17
8 415	USD Seagate Technology Holdings PLC	718 389	0,05	354 900	USD Amazon.com Inc	53 923 506	3,36
9 181	USD Trane Technologies PLC	2 239 246	0,14	10 776	USD Ameren Corp	779 536	0,05
4 272	USD Willis Towers Watson PLC	1 030 406	0,06	17 754	USD American Electric Power Co Inc	1 441 980	0,09
Irlande – Total				23 348	USD American Express Co	4 374 014	0,27
Jersey				3 000	USD American Financial Group Inc	356 670	0,02
7 700	USD Ferguson PLC	1 486 639	0,09	13 700	USD American Homes 4 Rent REIT	492 652	0,03
Jersey – Total				28 778	USD American International Group Inc	1 949 709	0,12
Pays-Bas				17 867	USD American Tower Corp REIT	3 857 128	0,24
10 200	USD NXP Semiconductors NV	2 342 736	0,15	7 661	USD American Water Works Co Inc	1 011 175	0,06
Pays-Bas – Total				3 678	USD Ameriprise Financial Inc	1 397 015	0,09
Suisse				9 009	USD AMETEK Inc	1 485 494	0,09
15 209	USD Chubb Ltd	3 437 234	0,21	20 413	USD Amgen Inc	5 879 352	0,37
6 459	USD Garmin Ltd	830 240	0,05	21 178	USD Amphenol Corp	2 099 375	0,13
12 504	USD TE Connectivity Ltd	1 756 812	0,11	18 756	USD Analog Devices Inc	3 724 191	0,23
Suisse – Total				16 451	USD Annaly Capital Management Inc	318 656	0,02
Royaume-Uni				2 876	USD ANSYS Inc	1 043 643	0,07
39 000	USD Amcor PLC	375 960	0,02	10 200	USD APA Corp	365 976	0,02
8 043	USD Aon PLC	2 340 674	0,15	15 372	USD Apollo Global Management Inc	1 432 517	0,09
11 420	USD Aptiv PLC	1 024 602	0,06	597 544	USD Apple Inc	115 045 146	7,17
38 500	USD CNH Industrial NV	468 930	0,03	32 030	USD Applied Materials Inc	5 191 102	0,32
18 626	USD Linde PLC	7 649 885	0,48	20 820	USD Archer-Daniels-Midland Co	1 503 620	0,09
6 858	USD Pentair PLC	498 645	0,03	5 800	USD Ares Management Corp	689 736	0,04
Royaume-Uni – Total				9 600	USD Arista Networks Inc	2 260 896	0,14
États-Unis				8 700	USD Arthur J Gallagher & Co	1 956 456	0,12
21 926	USD 3M Co	2 396 950	0,15	1 200	USD Aspen Technology Inc	264 180	0,02
5 900	USD A O Smith Corp	486 396	0,03	1 193	USD Assurant Inc	201 009	0,01
66 337	USD Abbott Laboratories	7 301 714	0,46	266 590	USD AT&T Inc	4 473 380	0,28
				5 900	USD Atmos Energy Corp	683 810	0,04
				7 693	USD Autodesk Inc	1 873 092	0,12
				15 265	USD Automatic Data Processing Inc	3 556 287	0,22
				707	USD AutoZone Inc	1 828 026	0,11

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
5 807	USD AvalonBay Communities Inc REIT	1 087 187	0,07	6 522	USD Cencora Inc	1 339 488	0,08
26 500	USD Avantor Inc	604 995	0,04	21 970	USD Centene Corp	1 630 394	0,10
3 487	USD Avery Dennison Corp	704 932	0,04	25 154	USD CenterPoint Energy Inc	718 650	0,04
3 100	USD Axon Enterprise Inc	800 823	0,05	6 232	USD Ceridian HCM Holding Inc	418 292	0,03
40 100	USD Baker Hughes Co	1 370 618	0,09	7 010	USD CF Industries Holdings Inc	557 295	0,03
12 792	USD Ball Corp	735 796	0,05	4 243	USD CH Robinson Worldwide Inc	366 553	0,02
273 328	USD Bank of America Corp	9 202 954	0,57	2 100	USD Charles River Laboratories International Inc	496 440	0,03
26 999	USD Bank of New York Mellon Corp	1 405 298	0,09	55 910	USD Charles Schwab Corp	3 846 608	0,24
15 311	USD Baxter International Inc	591 923	0,04	3 639	USD Charter Communications Inc	1 414 407	0,09
10 460	USD Becton Dickinson and Co	2 550 462	0,16	9 215	USD Cheniere Energy Inc	1 573 093	0,10
7 900	USD Bentley Systems Inc	412 222	0,03	3 400	USD Chesapeake Energy Corp	261 596	0,02
49 985	USD Berkshire Hathaway Inc	17 827 650	1,11	69 322	USD Chevron Corp	10 340 070	0,64
6 710	USD Best Buy Co Inc	525 259	0,03	1 096	USD Chipotle Mexican Grill Inc	2 506 508	0,16
4 000	USD Bill.com Holdings Inc	326 360	0,02	9 526	USD Church & Dwight Co Inc	900 779	0,06
5 662	USD Biogen Inc	1 465 156	0,09	11 796	USD Cigna Group	3 532 312	0,22
7 678	USD BioMarin Pharmaceutical Inc	740 313	0,05	6 366	USD Cincinnati Financial Corp	658 626	0,04
900	USD Bio-Rad Laboratories Inc	290 601	0,02	3 320	USD Cintas Corp	2 000 831	0,12
6 400	USD Bio-Techne Corp	493 824	0,03	156 452	USD Cisco Systems Inc	7 903 955	0,49
5 583	USD BlackRock Inc	4 532 279	0,28	71 376	USD Citigroup Inc	3 671 581	0,23
26 300	USD Blackstone Inc	3 443 196	0,21	19 400	USD Citizens Financial Group Inc	642 916	0,04
19 500	USD Block Inc	1 508 325	0,09	23 000	USD Cleveland-Cliffs Inc	469 660	0,03
1 411	USD Booking Holdings Inc	5 005 127	0,31	5 139	USD Clorox Co	732 770	0,05
5 200	USD Booz Allen Hamilton Holding Corp	665 132	0,04	10 200	USD Cloudflare Inc	849 252	0,05
7 083	USD BorgWarner Inc	253 926	0,02	13 787	USD CME Group Inc	2 903 542	0,18
6 200	USD Boston Properties Inc REIT	435 054	0,03	12 126	USD CMS Energy Corp	704 157	0,04
55 262	USD Boston Scientific Corp	3 194 696	0,20	156 997	USD Coca-Cola Co	9 251 833	0,58
79 687	USD Bristol-Myers Squibb Co	4 088 740	0,25	17 824	USD Cognizant Technology Solutions Corp	1 346 247	0,08
16 913	USD Broadcom Inc	18 879 136	1,18	6 900	USD Coinbase Global Inc	1 200 048	0,07
3 900	USD Broadridge Financial Solutions Inc	802 425	0,05	30 954	USD Colgate-Palmolive Co	2 467 343	0,15
10 000	USD Brown & Brown Inc	711 100	0,04	157 272	USD Comcast Corp	6 896 377	0,43
11 007	USD Brown-Forman Corp	628 500	0,04	20 470	USD Conagra Brands Inc	586 670	0,04
5 300	USD Builders FirstSource Inc	884 782	0,06	6 600	USD Confluent Inc	154 440	0,01
5 954	USD Bunge Global SA	601 056	0,04	44 803	USD ConocoPhillips	5 200 284	0,32
2 800	USD Burlington Stores Inc	544 544	0,03	11 452	USD Consolidated Edison Inc	1 041 788	0,07
10 000	USD Cadence Design Systems Inc	2 723 700	0,17	6 648	USD Constellation Brands Inc	1 607 154	0,10
9 000	USD Caesars Entertainment Inc	421 920	0,03	13 000	USD Constellation Energy Corp	1 519 570	0,09
4 141	USD Camden Property Trust REIT	411 160	0,03	2 033	USD Cooper Cos Inc	769 369	0,05
3 822	USD Campbell Soup Co	165 225	0,01	30 700	USD Copart Inc	1 504 300	0,09
15 251	USD Capital One Financial Corp	1 999 711	0,12	27 359	USD Corning Inc	833 082	0,05
8 889	USD Cardinal Health Inc	896 011	0,06	27 196	USD Corteva Inc	1 303 232	0,08
1 700	USD Carlisle Cos Inc	531 131	0,03	16 700	USD CoStar Group Inc	1 459 413	0,09
7 300	USD Carlyle Group Inc	297 037	0,02	16 946	USD Costco Wholesale Corp	11 185 716	0,70
6 742	USD CarMax Inc	517 381	0,03	24 500	USD Coterra Energy Inc	625 240	0,04
35 250	USD Carnival Corp	653 535	0,04	8 200	USD CrowdStrike Holdings Inc	2 093 624	0,13
33 417	USD Carrier Global Corp	1 919 807	0,12	16 967	USD Crown Castle Inc REIT	1 954 429	0,12
7 100	USD Catalent Inc	319 003	0,02	5 309	USD Crown Holdings Inc	488 906	0,03
19 485	USD Caterpillar Inc	5 761 130	0,36	73 407	USD CSX Corp	2 545 021	0,16
4 500	USD Cboe Global Markets Inc	803 520	0,05	5 004	USD Cummins Inc	1 198 808	0,07
12 598	USD Cbre Group Inc	1 172 748	0,07	48 616	USD CVS Health Corp	3 838 719	0,24
5 600	USD CDW Corp	1 272 992	0,08	26 852	USD Danaher Corp	6 211 942	0,39
2 911	USD Celanese Corp	452 282	0,03	3 963	USD Darden Restaurants Inc	651 121	0,04
3 600	USD Celsius Holdings Inc	196 272	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
5 800	USD Darling Ingredients Inc	289 072	0,02	9 150	USD Estee Lauder Cos Inc	1 338 187	0,08
8 800	USD Datadog Inc	1 068 144	0,07	5 371	USD Etsy Inc	435 320	0,03
2 383	USD DaVita Inc	249 643	0,02	9 600	USD Evergy Inc	501 120	0,03
1 000	USD Deckers Outdoor Corp	668 430	0,04	14 460	USD Eversource Energy	892 471	0,06
10 491	USD Deere & Co	4 195 036	0,26	7 400	USD Exact Sciences Corp	547 452	0,03
10 432	USD Dell Technologies Inc	798 048	0,05	39 592	USD Exelon Corp	1 421 353	0,09
6 113	USD Delta Air Lines Inc	245 926	0,02	4 533	USD Expedia Group Inc	688 064	0,04
26 600	USD Devon Energy Corp	1 204 980	0,08	5 476	USD Expeditors International of Washington Inc	696 547	0,04
15 700	USD Dexcom Inc	1 948 213	0,12	8 300	USD Extra Space Storage Inc REIT	1 330 739	0,08
7 100	USD Diamondback Energy Inc	1 101 068	0,07	153 126	USD Exxon Mobil Corp	15 309 537	0,95
2 200	USD Dick's Sporting Goods Inc	323 290	0,02	2 683	USD F5 Inc	480 203	0,03
11 930	USD Digital Realty Trust Inc REIT	1 605 539	0,10	1 600	USD FactSet Research Systems Inc	763 280	0,05
10 136	USD Discover Financial Services	1 139 286	0,07	900	USD Fair Isaac Corp	1 047 609	0,07
8 300	USD DocuSign Inc	493 435	0,03	20 070	USD Fastenal Co	1 299 934	0,08
8 343	USD Dollar General Corp	1 134 231	0,07	9 522	USD FedEx Corp	2 408 780	0,15
8 054	USD Dollar Tree Inc	1 144 071	0,07	11 318	USD Fidelity National Financial Inc	577 444	0,04
32 036	USD Dominion Energy Inc	1 505 692	0,09	24 088	USD Fidelity National Information Services Inc	1 446 966	0,09
1 500	USD Domino's Pizza Inc	618 345	0,04	28 789	USD Fifth Third Bancorp	992 933	0,06
10 100	USD DoorDash Inc	998 789	0,06	400	USD First Citizens BancShares Inc/NC	567 588	0,04
5 991	USD Dover Corp	921 476	0,06	3 800	USD First Solar Inc	654 664	0,04
27 996	USD Dow Inc	1 535 301	0,10	19 656	USD FirstEnergy Corp	720 589	0,04
12 155	USD DR Horton Inc	1 847 317	0,12	22 520	USD Fiserv Inc	2 991 557	0,19
16 700	USD DraftKings Inc	588 675	0,04	2 450	USD FleetCor Technologies Inc	692 395	0,04
12 200	USD Dropbox Inc	359 656	0,02	5 452	USD FMC Corp	343 749	0,02
8 183	USD DTE Energy Co	902 258	0,06	156 282	USD Ford Motor Co	1 905 078	0,12
29 477	USD Duke Energy Corp	2 860 448	0,18	26 400	USD Fortinet Inc	1 545 192	0,10
18 625	USD Dupont De Nemours Inc	1 432 821	0,09	14 333	USD Fortive Corp	1 055 339	0,07
8 500	USD Dynatrace Inc	464 865	0,03	5 700	USD Fortune Brands Innovations Inc	433 998	0,03
3 876	USD Eastman Chemical Co	348 142	0,02	8 259	USD Fox Corp	245 045	0,02
14 758	USD Eaton Corp PLC	3 554 022	0,22	6 876	USD Fox Corp	190 121	0,01
21 830	USD eBay Inc	952 225	0,06	13 065	USD Franklin Resources Inc	389 206	0,02
10 264	USD Ecolab Inc	2 035 864	0,13	52 100	USD Freeport-McMoRan Inc	2 217 897	0,14
12 989	USD Edison International	928 584	0,06	10 000	USD Gaming and Leisure Properties Inc REIT	493 500	0,03
24 310	USD Edwards Lifesciences Corp	1 853 637	0,12	3 100	USD Gartner Inc	1 398 441	0,09
10 478	USD Electronic Arts Inc	1 433 495	0,09	14 200	USD GE HealthCare Technologies Inc	1 097 944	0,07
9 322	USD Elevance Health Inc	4 395 882	0,27	24 483	USD Gen Digital Inc	558 702	0,03
30 883	USD Eli Lilly & Co	18 002 318	1,12	40 705	USD General Electric Co	5 195 179	0,32
23 120	USD Emerson Electric Co	2 250 270	0,14	23 578	USD General Mills Inc	1 535 871	0,10
4 700	USD Enphase Energy Inc	621 058	0,04	55 252	USD General Motors Co	1 984 652	0,12
5 700	USD Entegris Inc	682 974	0,04	5 911	USD Genuine Parts Co	818 674	0,05
6 996	USD Entergy Corp	707 925	0,04	49 680	USD Gilead Sciences Inc	4 024 577	0,25
21 335	USD EOG Resources Inc	2 580 468	0,16	9 021	USD Global Payments Inc	1 145 667	0,07
1 800	USD Epam Systems Inc	535 212	0,03	3 962	USD Globe Life Inc	482 255	0,03
14 900	USD EQT Corp	576 034	0,04	6 200	USD GoDaddy Inc	658 192	0,04
4 093	USD Equifax Inc	1 012 158	0,06	12 559	USD Goldman Sachs Group Inc	4 844 885	0,30
3 492	USD Equinix Inc REIT	2 812 422	0,18	6 700	USD Graco Inc	581 292	0,04
16 400	USD Equitable Holdings Inc	546 120	0,03	36 406	USD Halliburton Co	1 316 077	0,08
7 200	USD Equity LifeStyle Properties Inc REIT	507 888	0,03	11 904	USD Hartford Financial Services Group Inc	956 844	0,06
15 341	USD Equity Residential REIT	938 256	0,06	5 302	USD Hasbro Inc	270 720	0,02
1 200	USD Erie Indemnity Co	401 904	0,03				
9 800	USD Essential Utilities Inc	366 030	0,02				
1 980	USD Essex Property Trust Inc REIT	490 921	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
8 243 USD	HCA Healthcare Inc	2 231 215	0,14	42 500 USD	Keurig Dr Pepper Inc	1 416 100	0,09
22 633 USD	Healthpeak Properties Inc REIT	448 133	0,03	36 448 USD	KeyCorp	524 851	0,03
2 000 USD	HEICO Corp	357 740	0,02	6 700 USD	Keysight Technologies Inc	1 065 903	0,07
3 300 USD	HEICO Corp	470 052	0,03	13 565 USD	Kimberly-Clark Corp	1 648 283	0,10
2 926 USD	Henry Schein Inc	221 527	0,01	21 500 USD	Kimco Realty Corp REIT	458 165	0,03
5 578 USD	Hershey Co	1 039 962	0,06	79 467 USD	Kinder Morgan Inc	1 401 798	0,09
11 280 USD	Hess Corp	1 626 125	0,10	23 400 USD	KKR & Co Inc	1 938 690	0,12
40 695 USD	Hewlett Packard Enterprise Co	691 001	0,04	5 202 USD	KLA Corp	3 023 923	0,19
4 100 USD	HF Sinclair Corp	227 837	0,01	6 700 USD	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	386 255	0,02
10 361 USD	Hilton Worldwide Holdings Inc	1 886 634	0,12	29 914 USD	Kraft Heinz Co	1 106 220	0,07
7 098 USD	Hologic Inc	507 152	0,03	27 178 USD	Kroger Co	1 242 306	0,08
38 174 USD	Home Depot Inc	13 229 200	0,82	8 900 USD	L Brands Inc	384 124	0,02
25 387 USD	Honeywell International Inc	5 323 908	0,33	6 723 USD	L3Harris Technologies Inc	1 415 998	0,09
12 766 USD	Hormel Foods Corp	409 916	0,03	3 598 USD	Laboratory Corp of America Holdings	817 789	0,05
29 924 USD	Host Hotels & Resorts Inc REIT	582 620	0,04	5 013 USD	Lam Research Corp	3 926 482	0,24
15 881 USD	Howmet Aerospace Inc	859 480	0,05	5 200 USD	Lamb Weston Holdings Inc	562 068	0,04
30 395 USD	HP Inc	914 586	0,06	14 498 USD	Las Vegas Sands Corp	713 447	0,04
1 700 USD	Hubbell Inc	559 181	0,03	5 300 USD	Lattice Semiconductor Corp	365 647	0,02
1 870 USD	HubSpot Inc	1 085 610	0,07	2 500 USD	Lear Corp	353 025	0,02
4 411 USD	Humana Inc	2 019 400	0,13	5 600 USD	Leidos Holdings Inc	606 144	0,04
60 319 USD	Huntington Bancshares Inc	767 258	0,05	8 615 USD	Lennar Corp	1 283 980	0,08
1 700 USD	Huntington Ingalls Industries Inc	441 388	0,03	1 300 USD	Lennox International Inc	581 776	0,04
1 900 USD	Hyatt Hotels Corp	247 779	0,02	4 900 USD	Liberty Broadband Corp	394 891	0,02
2 200 USD	IDEX Corp	477 642	0,03	8 300 USD	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	523 979	0,03
2 900 USD	IDEXX Laboratories Inc	1 609 645	0,10	6 923 USD	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	199 244	0,01
12 098 USD	Illinois Tool Works Inc	3 168 950	0,20	4 500 USD	Live Nation Entertainment Inc	421 200	0,03
4 807 USD	Illumina Inc	669 327	0,04	9 846 USD	LKQ Corp	470 540	0,03
8 122 USD	Incyte Corp	509 980	0,03	7 441 USD	Loews Corp	517 819	0,03
14 001 USD	Ingersoll Rand Inc	1 082 837	0,07	22 107 USD	Lowe's Cos Inc	4 919 913	0,31
2 900 USD	Insulet Corp	629 242	0,04	3 300 USD	LPL Financial Holdings Inc	751 146	0,05
160 059 USD	Intel Corp	8 042 965	0,50	18 100 USD	Lucid Group Inc	76 201	0,00
20 970 USD	Intercontinental Exchange Inc	2 693 177	0,17	10 959 USD	LyondellBasell Industries NV	1 041 982	0,07
35 196 USD	International Business Machines Corp	5 756 306	0,36	5 563 USD	M&T Bank Corp	762 576	0,05
10 773 USD	International Flavors & Fragrances Inc	872 290	0,05	2 500 USD	Manhattan Associates Inc	538 300	0,03
10 987 USD	International Paper Co	397 180	0,02	20 400 USD	Marathon Oil Corp	492 864	0,03
13 726 USD	Interpublic Group of Cos Inc	448 017	0,03	15 969 USD	Marathon Petroleum Corp	2 369 161	0,15
10 733 USD	Intuit Inc	6 708 447	0,42	440 USD	Markel Group Inc	624 756	0,04
13 469 USD	Intuitive Surgical Inc	4 543 902	0,28	1 800 USD	MarketAxess Holdings Inc	527 130	0,03
18 900 USD	Invitation Homes Inc REIT	644 679	0,04	9 212 USD	Marriott International Inc	2 077 398	0,13
7 403 USD	IQVIA Holdings Inc	1 712 906	0,11	19 665 USD	Marsh & McLennan Cos Inc	3 725 928	0,23
12 040 USD	Iron Mountain Inc REIT	842 559	0,05	2 535 USD	Martin Marietta Materials Inc	1 264 737	0,08
4 511 USD	J M Smucker Co	570 100	0,04	34 815 USD	Marvell Technology Inc	2 099 693	0,13
5 200 USD	Jabil Inc	662 480	0,04	8 443 USD	Masco Corp	565 512	0,04
3 000 USD	Jack Henry & Associates Inc	490 230	0,03	32 163 USD	Mastercard Inc	13 717 841	0,85
5 396 USD	Jacobs Solutions Inc	700 401	0,04	12 187 USD	Match Group Inc	444 826	0,03
3 565 USD	JB Hunt Transport Services Inc	712 073	0,04	9 352 USD	McCormick & Co Inc	639 864	0,04
92 085 USD	Johnson & Johnson	14 433 403	0,90	27 824 USD	McDonald's Corp	8 250 094	0,51
111 034 USD	JPMorgan Chase & Co	18 886 883	1,18	4 922 USD	McKesson Corp	2 278 788	0,14
13 941 USD	Juniper Networks Inc	410 981	0,03	96 946 USD	Merck & Co Inc	10 569 053	0,66
7 613 USD	Kellanova	425 643	0,03				
65 500 USD	Kenvue Inc	1 410 215	0,09				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
84 961	USD Meta Platforms Inc	30 072 796	1,87	12 626	USD Paychex Inc	1 503 883	0,09
22 087	USD MetLife Inc	1 460 613	0,09	2 100	USD Paycom Software Inc	434 112	0,03
	917 USD Mettler-Toledo International Inc	1 112 284	0,07	1 400	USD Paylocity Holding Corp	230 790	0,01
11 743	USD MGM Resorts International Inc	524 677	0,03	41 130	USD PayPal Holdings Inc	2 525 793	0,16
19 608	USD Microchip Technology Inc	1 768 249	0,11	52 580	USD PepsiCo Inc	8 930 187	0,56
43 706	USD Micro Technology Inc	3 729 870	0,23	215 671	USD Pfizer Inc	6 209 168	0,39
269 747	USD Microsoft Corp	101 435 662	6,32	77 600	USD PG&E Corp	1 399 128	0,09
	4 200 USD Mid-America Apartment Communities Inc REIT	564 732	0,04	59 358	USD Philip Morris International Inc	5 584 401	0,35
12 400	USD Moderna Inc	1 233 180	0,08	16 147	USD Phillips 66	2 149 812	0,13
2 100	USD Molina Healthcare Inc	758 751	0,05	23 900	USD Pinterest Inc	885 256	0,06
7 722	USD Molson Coors Beverage Co	472 664	0,03	9 237	USD Pioneer Natural Resources Co	2 077 217	0,13
51 982	USD Mondelez International Inc	3 765 056	0,23	14 449	USD PNC Financial Services Group Inc	2 237 428	0,14
2 400	USD MongoDB Inc	981 240	0,06	1 100	USD Pool Corp	438 581	0,03
1 853	USD Monolithic Power Systems Inc	1 168 835	0,07	7 900	USD PPG Industries Inc	1 181 445	0,07
28 054	USD Monster Beverage Corp	1 616 191	0,10	22 311	USD PPL Corp	604 628	0,04
6 074	USD Moody's Corp	2 372 261	0,15	8 541	USD Principal Financial Group Inc	671 920	0,04
46 277	USD Morgan Stanley	4 315 330	0,27	90 124	USD Procter & Gamble Co	13 206 771	0,82
11 591	USD Mosaic Co	414 146	0,03	21 676	USD Progressive Corp	3 452 553	0,22
6 737	USD Motorola Solutions Inc	2 109 287	0,13	35 376	USD Prologis Inc REIT	4 715 621	0,29
3 000	USD MSCI Inc	1 696 950	0,11	14 715	USD Prudential Financial Inc	1 526 093	0,10
14 310	USD Nasdaq Inc	831 983	0,05	4 600	USD PTC Inc	804 816	0,05
8 080	USD NetApp Inc	712 333	0,04	19 476	USD Public Service Enterprise Group Inc	1 190 957	0,07
16 946	USD Netflix Inc	8 250 668	0,51	6 263	USD Public Storage REIT	1 910 215	0,12
3 700	USD Neurocrine Biosciences Inc	487 512	0,03	8 587	USD PulteGroup Inc	886 350	0,06
46 552	USD Newmont Corp	1 926 787	0,12	4 532	USD Qorvo Inc	510 349	0,03
17 729	USD News Corp	435 247	0,03	42 678	USD Qualcomm Inc	6 172 519	0,38
78 212	USD NextEra Energy Inc	4 750 597	0,30	6 000	USD Quanta Services Inc	1 294 800	0,08
46 804	USD NIKE Inc	5 081 510	0,32	4 198	USD Quest Diagnostics Inc	578 820	0,04
17 800	USD NiSource Inc	472 590	0,03	8 142	USD Raymond James Financial Inc	907 833	0,06
2 200	USD Nordson Corp	581 152	0,04	27 109	USD Realty Income Corp REIT	1 556 599	0,10
7 974	USD Norfolk Southern Corp	1 884 894	0,12	6 554	USD Regency Centers Corp REIT	439 118	0,03
7 426	USD Northern Trust Corp	626 606	0,04	3 994	USD Regeneron Pharmaceuticals Inc	3 507 890	0,22
9 600	USD NRG Energy Inc	496 320	0,03	30 177	USD Regions Financial Corp	584 830	0,04
9 802	USD Nucor Corp	1 705 940	0,11	2 400	USD Reliance Steel & Aluminum Co	671 232	0,04
94 427	USD Nvidia Corp	46 762 139	2,91	1 400	USD Repligen Corp	251 720	0,02
	130 USD NVR Inc	910 058	0,06	7 781	USD Republic Services Inc	1 283 165	0,08
26 905	USD Occidental Petroleum Corp	1 606 498	0,10	5 852	USD ResMed Inc	1 006 661	0,06
7 100	USD Okta Inc	642 763	0,04	4 900	USD Revvity Inc	535 619	0,03
3 500	USD Old Dominion Freight Line Inc	1 418 655	0,09	24 500	USD Rivian Automotive Inc	574 770	0,04
6 887	USD Omnicom Group Inc	595 794	0,04	4 620	USD Robert Half Inc	406 190	0,03
15 200	USD On Semiconductor Corp	1 269 656	0,08	24 400	USD Robinhood Markets Inc	310 856	0,02
23 302	USD ONEOK Inc	1 636 266	0,10	15 400	USD Roblox Corp	704 088	0,04
62 805	USD Oracle Corp	6 621 531	0,41	3 985	USD Rockwell Automation Inc	1 237 263	0,08
2 187	USD O'Reilly Automotive Inc	2 077 825	0,13	5 300	USD Roku Inc	485 798	0,03
16 158	USD Otis Worldwide Corp	1 445 656	0,09	9 225	USD Rollins Inc	402 856	0,03
4 100	USD Owens Corning	607 743	0,04	4 222	USD Roper Technologies Inc	2 301 708	0,14
21 197	USD Paccar Inc	2 069 887	0,13	13 592	USD Ross Stores Inc	1 880 997	0,12
3 900	USD Packaging Corp of America	635 349	0,04	9 598	USD Royal Caribbean Cruises Ltd	1 242 845	0,08
74 800	USD Palantir Technologies Inc	1 284 316	0,08	14 800	USD Royalty Pharma PLC	415 732	0,03
12 311	USD Palo Alto Networks Inc	3 630 268	0,23	5 400	USD RPM International Inc	602 802	0,04
12 040	USD Paramount Global	178 072	0,01	55 537	USD RTX Corp	4 672 883	0,29
4 599	USD Parker-Hannifin Corp	2 118 759	0,13	12 637	USD S&P Global Inc	5 566 851	0,35

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
37 212	USD Salesforce Inc	9 791 966	0,61	7 200	USD Twilio Inc	546 264	0,03
3 750	USD SBA Communications Corp REIT	951 337	0,06	1 700	USD Tyler Technologies Inc	710 804	0,04
53 565	USD Schlumberger NV	2 787 523	0,17	10 133	USD Tyson Foods Inc	544 649	0,03
4 687	USD SEI Investments Co	297 859	0,02	70 300	USD Uber Technologies Inc	4 328 371	0,27
22 560	USD Sempra	1 685 909	0,11	13 467	USD UDR Inc REIT	515 651	0,03
7 974	USD ServiceNow Inc	5 633 551	0,35	3 600	USD U-Haul Holding Co	253 584	0,02
9 021	USD Sherwin-Williams Co	2 813 650	0,18	15 100	USD UiPath Inc	375 084	0,02
11 701	USD Simon Property Group Inc REIT	1 669 031	0,10	2 013	USD Ulta Beauty Inc	986 350	0,06
33 778	USD Sirius XM Holdings Inc	184 766	0,01	23 317	USD Union Pacific Corp	5 727 122	0,36
6 341	USD Skyworks Solutions Inc	712 855	0,04	26 978	USD United Parcel Service Inc	4 241 751	0,26
30 800	USD Snap Inc	521 444	0,03	2 711	USD United Rentals Inc	1 554 542	0,10
1 835	USD Snap-on Inc	530 021	0,03	1 200	USD United Therapeutics Corp	263 868	0,02
11 200	USD Snowflake Inc	2 228 800	0,14	35 443	USD UnitedHealth Group Inc	18 659 676	1,16
42 928	USD Southern Co	3 010 111	0,19	8 400	USD Unity Software Inc	343 476	0,02
6 672	USD Southwest Airlines Co	192 687	0,01	1 309	USD Universal Health Services Inc	199 544	0,01
6 600	USD Splunk Inc	1 005 510	0,06	56 159	USD US Bancorp	2 430 562	0,15
9 000	USD SS&C Technologies Holdings Inc	549 990	0,03	1 800	USD Vail Resorts Inc	384 246	0,02
5 161	USD Stanley Black & Decker Inc	506 294	0,03	12 629	USD Valero Energy Corp	1 641 770	0,10
42 687	USD Starbucks Corp	4 098 379	0,26	5 900	USD Veeva Systems Inc	1 135 868	0,07
12 280	USD State Street Corp	951 209	0,06	16 759	USD Ventas Inc REIT	835 269	0,05
5 800	USD Steel Dynamics Inc	684 980	0,04	9 500	USD Veralto Corp	781 470	0,05
4 000	USD Steris Plc	879 400	0,05	2 848	USD VeriSign Inc	586 574	0,04
13 591	USD Stryker Corp	4 069 961	0,25	5 722	USD Verisk Analytics Inc	1 366 757	0,09
4 800	USD Sun Communities Inc REIT	641 520	0,04	160 797	USD Verizon Communications Inc	6 062 047	0,38
1 600	USD Super Micro Computer Inc	454 816	0,03	9 904	USD Vertex Pharmaceuticals Inc	4 029 839	0,25
14 517	USD Synchro Financial	554 404	0,03	11 400	USD Vertiv Holdings Co	547 542	0,03
5 746	USD Synopsys Inc	2 958 673	0,18	13 930	USD VF Corp	261 884	0,02
17 739	USD Sysco Corp	1 297 253	0,08	50 886	USD Viatris Inc	551 095	0,03
9 578	USD T Rowe Price Group Inc	1 031 455	0,06	39 000	USD VICI Properties Inc REIT	1 243 320	0,08
6 800	USD Take-Two Interactive Software Inc	1 094 460	0,07	61 394	USD Visa Inc	15 983 928	1,00
9 500	USD Targa Resources Corp	825 265	0,05	14 200	USD Vistra Corp	546 984	0,03
18 313	USD Target Corp	2 608 137	0,16	4 528	USD Vulcan Materials Co	1 027 901	0,06
1 700	USD Teledyne Technologies Inc	758 693	0,05	8 904	USD W R Berkley Corp	629 691	0,04
1 200	USD Teleflex Inc	299 208	0,02	27 202	USD Walgreens Boots Alliance Inc	710 244	0,04
6 800	USD Teradyne Inc	737 936	0,05	56 600	USD Walmart Inc	8 922 990	0,56
109 215	USD Tesla Inc	27 137 743	1,69	69 901	USD Walt Disney Co	6 311 361	0,39
34 717	USD Texas Instruments Inc	5 917 860	0,37	90 679	USD Warner Bros Discovery Inc	1 031 927	0,06
200	USD Texas Pacific Land Corp	314 490	0,02	16 187	USD Waste Management Inc	2 899 092	0,18
7 039	USD Textron Inc	566 076	0,04	1 763	USD Waters Corp	580 432	0,04
14 704	USD Thermo Fisher Scientific Inc	7 804 736	0,49	1 200	USD Watsco Inc	514 164	0,03
42 440	USD TJX Cos Inc	3 981 296	0,25	10 789	USD WEC Energy Group Inc	908 110	0,06
21 112	USD T-Mobile US Inc	3 384 887	0,21	139 867	USD Wells Fargo & Co	6 884 254	0,43
16 600	USD Toast Inc	303 116	0,02	18 606	USD Welltower Inc REIT	1 677 703	0,10
3 000	USD Toro Co	287 970	0,02	3 100	USD West Pharmaceutical Services Inc	1 091 572	0,07
3 674	USD Tractor Supply Co	790 020	0,05	13 146	USD Western Digital Corp	688 456	0,04
17 100	USD Trade Desk Inc	1 230 516	0,08	5 965	USD Westinghouse Air Brake Technologies Corp	756 959	0,05
4 500	USD Tradeweb Markets Inc	408 960	0,03	1 600	USD Westlake Corp	223 936	0,01
2 100	USD TransDigm Group Inc	2 124 360	0,13	8 117	USD WestRock Co	337 018	0,02
8 000	USD TransUnion	549 680	0,03	24 633	USD Weyerhaeuser Co REIT	856 489	0,05
9 048	USD Travelers Cos Inc	1 723 554	0,11	48 689	USD Williams Cos Inc	1 695 838	0,11
8 113	USD Trimble Inc	431 612	0,03	8 251	USD Workday Inc	2 277 771	0,14
51 705	USD Truist Financial Corp	1 908 949	0,12	8 100	USD WP Carey Inc REIT	524 961	0,03

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
1 602 USD	WW Grainger Inc	1 327 561	0,08	9 100 USD	Zoom Video Communications Inc	654 381	0,04
4 432 USD	Wynn Resorts Ltd	403 800	0,03	3 500 USD	Zscaler Inc	775 460	0,05
21 676 USD	Xcel Energy Inc	1 341 961	0,08	États-Unis – Total			
10 363 USD	Xylem Inc	1 185 113	0,07	1 542 728 203 96,14			
9 578 USD	Yum! Brands Inc	1 251 461	0,08	Total des actions ordinaires et préférentielles			
2 200 USD	Zebra Technologies Corp	601 326	0,04	1 594 027 974 99,33			
7 500 USD	Zillow Group Inc	433 950	0,03	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
8 748 USD	Zimmer Biomet Holdings Inc	1 064 632	0,07	1 594 027 974 99,33			
18 189 USD	Zoetis Inc	3 589 963	0,22	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
				1 594 027 974 99,33			

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – 0,21 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Bank of Montreal	89 240 446	97 565 375	1 014 096	0,06
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	112 549 765	122 970 375	1 357 738	0,09
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	89 282 953	97 565 375	1 061 051	0,07
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	89 291 042	97 565 375	1 069 987	0,07
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	UBS AG	8 095 040	8 893 000	49 187	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	100 401 875	90 583 260	339 064	0,02
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	100 401 875	90 692 134	218 796	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	83 878 375	75 460 500	520 924	0,03
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	UBS AG	110 832 875	100 201 316	145 478	0,01
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				5 776 321	0,36

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	75 367 974	83 878 375	(525 627)	(0,03)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Deutsche Bank AG	75 475 669	83 878 375	(406 522)	(0,03)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	75 371 374	83 878 375	(521 867)	(0,03)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	UBS AG	75 372 105	83 878 375	(521 058)	(0,03)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	16 801 500	15 383 096	(191 439)	(0,01)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Merrill Lynch International	10 294 000	9 549 995	(255 403)	(0,02)
	Westpac Banking Corporation	1 949 000	1 775 190	(11 963)	(0,00)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(2 433 879)	(0,15)
Total des contrats de change à terme – couverture				3 342 442	0,21

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats à terme standardisés – 0,01 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
S&P EMINI INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	31	7 471 000	189 090	0,01
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			7 471 000	189 090	0,01
Total des contrats à terme standardisés			7 471 000	189 090	0,01
Autres actifs/(passifs) nets				7 167 811	0,45
TOTAL DES ACTIFS NETS				1 604 727 317	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 157 722 USD détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,62 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,62 % (<i>suite</i>)				
Autriche				France (<i>suite</i>)				
18 892 EUR	Erste Group Bank AG	693 903	0,26	37 007 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	1 201 247	0,45	
7 763 EUR	OMV AG	308 735	0,12	2 824 EUR	Covivio SA REIT	137 472	0,05	
3 983 EUR	Verbund AG	334 771	0,13	58 848 EUR	Credit Agricole SA	756 315	0,28	
6 078 EUR	voestalpine AG	173 588	0,06	35 123 EUR	Danone SA	2 061 018	0,77	
Autriche – Total				1 234 EUR	Dassault Aviation SA	221 133	0,08	
Belgique				36 451 EUR	Dassault Systemes SE	1 612 410	0,60	
8 038 EUR	Ageas SA/NV	315 974	0,12	13 948 EUR	Edenred SE	755 145	0,28	
47 381 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV	2 767 998	1,04	4 233 EUR	Eiffage SA	410 686	0,15	
1 257 EUR	D'ieteren Group	222 363	0,08	99 632 EUR	Engie SA	1 585 942	0,59	
1 635 EUR	Elia Group SA/NV	185 246	0,07	16 083 EUR	EssilorLuxottica SA	2 920 673	1,09	
5 218 EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV	371 626	0,14	2 386 EUR	Eurazeo SE	171 434	0,07	
14 151 EUR	KBC Group NV	830 947	0,31	2 095 EUR	Gecina SA REIT	230 660	0,09	
25 EUR	Lotus Bakeries NV	205 750	0,08	20 224 EUR	Getlink SE	335 011	0,13	
836 EUR	Sofina SA	188 434	0,07	1 728 EUR	Hermes International SCA	3 315 686	1,24	
3 766 EUR	Syensqo SA	354 983	0,13	2 097 EUR	Ipsen SA	226 266	0,09	
6 781 EUR	Ucb SA	535 021	0,20	4 061 EUR	Kering SA	1 620 339	0,61	
12 262 EUR	Umicore SA	305 324	0,11	12 210 EUR	Klepierre SA REIT	301 343	0,11	
9 589 EUR	Warehouses De Pauw CVA REIT	273 286	0,10	4 943 EUR	La Francaise des Jeux SAEM	162 328	0,06	
Belgique – Total				14 460 EUR	Legrand SA	1 360 686	0,51	
Finlande				13 157 EUR	L'Oreal SA	5 929 202	2,22	
7 298 EUR	Elisa OYJ	305 567	0,11	15 062 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	11 049 483	4,14	
22 432 EUR	Fortum Oyj	292 962	0,11	101 572 EUR	Orange SA	1 046 598	0,39	
16 326 EUR	Kesko Oyj	292 644	0,11	11 156 EUR	Pernod Ricard SA	1 782 171	0,67	
19 200 EUR	Kone Oyj	867 072	0,32	12 157 EUR	Publicis Groupe SA	1 021 188	0,38	
34 143 EUR	Metso Oyj	313 091	0,12	1 277 EUR	Remy Cointreau SA	146 855	0,06	
23 881 EUR	Neste Oyj	769 207	0,29	9 797 EUR	Renault SA	361 558	0,14	
286 193 EUR	Nokia Oyj	873 461	0,33	18 645 EUR	Safran SA	2 973 132	1,11	
177 386 EUR	Nordea Bank Abp	1 991 335	0,75	62 092 EUR	Sanofi SA	5 573 378	2,09	
5 724 EUR	Orion Oyj	224 782	0,08	1 574 EUR	Sartorius Stedim Biotech	376 973	0,14	
23 954 EUR	Sampo Oyj	948 818	0,36	29 685 EUR	Schneider Electric SE	5 396 139	2,02	
33 689 EUR	Stora Enso OYJ	421 955	0,16	1 117 EUR	SEB SA	126 221	0,05	
28 300 EUR	UPM-Kymmene Oyj	963 898	0,36	40 294 EUR	Societe Generale SA	968 063	0,36	
27 450 EUR	Wartsila OYJ Abp	360 281	0,13	4 860 EUR	Sodexo SA	484 153	0,18	
Finlande – Total				3 232 EUR	Teleperformance SE	426 786	0,16	
France				5 534 EUR	Thales SA	741 279	0,28	
11 039 EUR	Accor SA	381 949	0,14	125 006 EUR	TotalEnergies SE	7 700 370	2,88	
1 637 EUR	Aeroports de Paris SA	191 856	0,07	6 768 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield REIT	452 915	0,17	
28 570 EUR	Air Liquide SA	5 031 748	1,88	36 171 EUR	Veolia Environnement SA	1 033 044	0,39	
32 336 EUR	Airbus SE	4 519 926	1,69	27 694 EUR	Vinci SA	3 148 808	1,18	
15 580 EUR	Alstom SA	189 764	0,07	33 799 EUR	Vivendi SE	327 039	0,12	
3 377 EUR	Amundi SA	208 023	0,08	13 088 EUR	Worldline SA	205 089	0,08	
3 546 EUR	Arkema SA	365 238	0,14	France – Total			93 030 089	34,83
98 407 EUR	AXA SA	2 902 022	1,09	Allemagne				
2 331 EUR	BioMerieux	234 499	0,09	8 906 EUR	adidas AG	1 640 129	0,61	
57 301 EUR	BNP Paribas SA	3 586 470	1,34	22 000 EUR	Allianz SE	5 322 900	1,99	
44 256 EUR	Bolloré SE	250 268	0,09	48 686 EUR	BASF SE	2 374 903	0,89	
9 953 EUR	Bouygues SA	339 596	0,13	53 986 EUR	Bayer AG	1 815 549	0,68	
17 045 EUR	Bureau Veritas SA	389 819	0,15	17 395 EUR	Bayerische Motoren Werke AG	1 753 068	0,66	
8 522 EUR	Capgemini SE	1 608 527	0,60	3 389 EUR	Bayerische Motoren Werke AG–Preferred Stock	304 841	0,11	
31 201 EUR	Carrefour SA	516 845	0,19	3 865 EUR	Bechtle AG	175 432	0,07	
24 862 EUR	Cie de Saint-Gobain SA	1 657 301	0,62					

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,62 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,62 % (suite)				
Allemagne (suite)				Irlande				
5 296	EUR Beiersdorf AG	718 667	0,27	11 500	USD AerCap Holdings NV	773 711	0,29	
7 255	EUR Brenntag SE	603 761	0,23	83 938	EUR AIB Group PLC	325 679	0,12	
1 922	EUR Carl Zeiss Meditec AG	189 970	0,07	54 354	EUR Bank of Ireland Group PLC	446 681	0,17	
59 128	EUR Commerzbank AG	636 217	0,24	9 637	EUR Flutter Entertainment PLC	1 541 920	0,58	
6 326	EUR Continental AG	486 596	0,18	8 823	EUR Kerry Group PLC	694 017	0,26	
10 763	EUR Covestro AG	566 995	0,21	8 102	EUR Kingspan Group PLC	635 197	0,24	
29 079	EUR Daimler Truck Holding AG	989 268	0,37	14 537	EUR Smurfit Kappa Group PLC	521 588	0,19	
8 711	EUR Delivery Hero SE	217 862	0,08	Irlande – Total			4 938 793	1,85
103 473	EUR Deutsche Bank AG	1 279 340	0,48	Italie				
10 364	EUR Deutsche Boerse AG	1 932 886	0,72	5 946	EUR Amplifon SpA	186 348	0,07	
33 899	EUR Deutsche Lufthansa AG	272 819	0,10	53 871	EUR Assicurazioni Generali SpA	1 029 206	0,38	
54 071	EUR Deutsche Post AG	2 425 355	0,91	61 160	EUR Banco BPM SpA	292 406	0,11	
176 804	EUR Deutsche Telekom AG	3 845 487	1,44	29 754	EUR Davide Campari-Milano NV	303 937	0,11	
6 580	EUR Dr Ing hc F Porsche AG	525 742	0,20	1 395	EUR DiaSorin SpA	130 070	0,05	
122 469	EUR EON SE	1 487 998	0,56	443 665	EUR Enel SpA	2 985 865	1,12	
11 531	EUR Evonik Industries AG	213 324	0,08	128 908	EUR Eni SpA	1 978 480	0,74	
11 645	EUR Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	442 044	0,17	6 876	EUR Ferrari NV	2 098 555	0,79	
22 104	EUR Fresenius SE & Co KGaA	620 459	0,23	34 579	EUR FinecoBank Banca Fineco SpA	469 756	0,18	
8 929	EUR GEA Group AG	336 534	0,13	17 943	EUR Infrastrutture Wireless Italiane SpA	205 447	0,08	
3 370	EUR Hannover Rueck SE	728 931	0,27	837 322	EUR Intesa Sanpaolo SpA	2 213 461	0,83	
7 611	EUR Heidelberg Materials AG	616 034	0,23	20 128	EUR Leonardo SpA	300 612	0,11	
9 050	EUR Hellofresh SE	129 506	0,05	27 711	EUR Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	310 502	0,12	
5 423	EUR Henkel AG & Co KGaA	352 387	0,13	11 462	EUR Moncler SpA	638 433	0,24	
9 379	EUR Henkel AG & Co KGaA–Preferred Stock	683 354	0,26	34 026	EUR Nexi SpA	251 997	0,09	
71 237	EUR Infineon Technologies AG	2 692 759	1,01	31 238	EUR Poste Italiane SpA	320 970	0,12	
4 027	EUR Knorr-Bremse AG	236 788	0,09	14 490	EUR Prysmian SpA	596 553	0,22	
3 702	EUR LEG Immobilien SE	293 643	0,11	6 221	EUR Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	303 771	0,11	
43 338	EUR Mercedes-Benz Group AG	2 710 792	1,01	114 698	EUR Snam SpA	533 919	0,20	
6 858	EUR Merck KGaA	988 238	0,37	576 879	EUR Telecom Italia SpA/Milano	169 718	0,06	
3 073	EUR MTU Aero Engines AG	600 003	0,22	76 664	EUR Terna - Rete Elettrica Nazionale	579 120	0,22	
7 444	EUR Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	2 792 244	1,05	87 616	EUR UniCredit SpA	2 152 287	0,81	
3 276	EUR Nemetschek SE	257 101	0,10	Italie – Total			18 051 413	6,76
6 021	EUR Puma SE	304 181	0,11	Luxembourg				
282	EUR Rational AG	197 259	0,07	28 039	EUR ArcelorMittal SA	719 901	0,27	
2 477	EUR Rheinmetall AG	710 899	0,27	7 106	EUR Eurofins Scientific SE	419 112	0,15	
33 841	EUR RWE AG	1 393 572	0,52	26 965	EUR Tenaris SA	424 564	0,16	
56 962	EUR SAP SE	7 945 060	2,97	Luxembourg – Total			1 563 577	0,58
1 490	EUR Sartorius AG–Preferred Stock	496 468	0,19	Pays-Bas				
4 261	EUR Scout24 SE	273 386	0,10	23 247	EUR ABN AMRO Bank NV	315 927	0,12	
41 457	EUR Siemens AG	7 044 373	2,64	1 184	EUR Adyen NV	1 381 254	0,52	
15 760	EUR Siemens Healthineers AG	828 976	0,31	88 341	EUR Aegon Ltd	463 614	0,17	
6 991	EUR Symrise AG	696 583	0,26	8 945	EUR Akzo Nobel NV	669 265	0,25	
3 473	EUR Talanx AG	224 529	0,08	3 159	EUR Argenx SE	1 085 116	0,41	
39 980	EUR Vonovia SE	1 141 029	0,43	2 638	EUR ASM International NV	1 239 728	0,46	
1 144	EUR Wacker Chemie AG	130 759	0,05	21 991	EUR ASML Holding NV	14 991 265	5,61	
12 415	EUR Zalando SE	266 302	0,10	9 054	EUR ASR Nederland NV	386 606	0,15	
Allemagne – Total			24,68	4 011	EUR BE Semiconductor Industries NV	547 301	0,21	
				4 674	EUR Euronext NV	367 610	0,14	
				4 820	EUR EXOR NV	436 210	0,16	

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets			
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)						
Actions ordinaires et préférentielles – 99,62 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,62 % (suite)						
Pays-Bas (suite)				Espagne (suite)						
28 604	EUR Ferrovial SE	944 504	0,35	30 595	EUR Cellnex Telecom SA	1 091 018	0,41			
6 718	EUR Heineken Holding NV	514 599	0,19	3 674	EUR Corp ACCIONA Energias Renovables SA	103 166	0,04			
15 710	EUR Heineken NV	1 444 377	0,54	15 276	EUR EDP Renovaveis SA	282 988	0,11			
2 935	EUR IMCD NV	462 409	0,17	14 382	EUR Enagas SA	219 541	0,08			
197 440	EUR ING Groep NV	2 670 573	1,00	17 325	EUR Endesa SA	319 819	0,12			
3 996	EUR JDE Peet's NV	97 343	0,04	17 541	EUR Grifols SA	271 096	0,10			
52 408	EUR Koninklijke Ahold Delhaize NV	1 363 394	0,51	329 081	EUR Iberdrola SA	3 906 191	1,46			
193 397	EUR Koninklijke KPN NV	603 012	0,23	58 788	EUR Industria de Diseno Textil SA	2 318 011	0,87			
43 043	EUR Koninklijke Philips NV	907 562	0,34	7 039	EUR Naturgy Energy Group SA	190 053	0,07			
15 520	EUR NN Group NV	554 840	0,21	23 201	EUR Redeia Corp SA	345 927	0,13			
5 312	EUR OCI NV	139 387	0,05	68 741	EUR Repsol SA	924 566	0,35			
79 792	EUR Prosus NV	2 153 187	0,81	274 627	EUR Telefonica SA	970 532	0,36			
13 078	EUR Qiagen Nv	515 273	0,19	Espagne – Total			20 666 230	7,74		
5 672	EUR Randstad NV	321 716	0,12	Suisse						
120 684	EUR Stellantis NV	2 552 467	0,96	10 471	EUR DSM-Firmenich AG	963 332	0,36			
13 556	EUR Wolters Kluwer NV	1 744 657	0,65	29 697	EUR Siemens Energy AG	356 364	0,14			
Pays-Bas – Total				37 282				EUR STMicroelectronics NV	1 686 824	0,63
				Suisse – Total				3 006 520	1,13	
Portugal				Royaume-Uni						
176 891	EUR EDP - Energias de Portugal SA	805 738	0,30	11 430	USD Coca-Cola Europacific Partners PLC	690 570	0,26			
22 786	EUR Galp Energia SGPS SA	303 965	0,11	Royaume-Uni – Total				690 570	0,26	
15 588	EUR Jeronimo Martins SGPS SA	359 148	0,14	États-Unis						
Portugal – Total				44 716				EUR Universal Music Group NV	1 154 120	0,43
				États-Unis – Total				1 154 120	0,43	
Espagne				Total des actions ordinaires et préférentielles				266 049 683	99,62	
1 313	EUR Acciona SA	175 023	0,07	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				266 049 683	99,62	
10 703	EUR ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	429 832	0,16	TOTAL DES INVESTISSEMENTS				266 049 683	99,62	
3 929	EUR Aena SME SA	644 749	0,24							
24 574	EUR Amadeus IT Group SA	1 594 361	0,60							
325 410	EUR Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	2 676 823	1,00							
882 827	EUR Banco Santander SA	3 336 645	1,25							
232 391	EUR CaixaBank SA	865 889	0,32							

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – (0,00) %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Moins-values latentes	% des actifs nets
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE, due 15/03/24	EUR	5	227 150	(1 050)	(0,00)
Moins-values latentes sur contrats à terme standardisés				(1 050)	(0,00)
Total des contrats à terme standardisés				(1 050)	(0,00)
Autres actifs/(passifs) nets				1 009 888	0,38
TOTAL DES ACTIFS NETS				267 058 521	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 18 231 EUR détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 % <i>(suite)</i>				
Autriche				Finlande <i>(suite)</i>				
21 876	EUR Erste Group Bank AG	803 505	0,13	40 513	EUR Stora Enso OYJ	507 425	0,08	
10 215	EUR OMV AG	406 251	0,06	34 440	EUR UPM-Kymmene Oyj	1 173 026	0,18	
4 194	EUR Verbund AG	352 506	0,06	32 098	EUR Wartsila OYJ Abp	421 286	0,07	
8 667	EUR voestalpine AG	247 529	0,04	Finlande – Total			10 457 332	1,65
Autriche – Total			1 809 791	0,29	France			
Belgique				11 491	EUR Accor SA	397 589	0,06	
10 104	EUR Ageas SA/NV	397 188	0,06	2 590	EUR Aeroports de Paris SA	303 548	0,05	
57 493	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV	3 358 741	0,53	34 772	EUR Air Liquide SA	6 124 045	0,97	
1 250	EUR D'ieteren Group	221 125	0,04	39 298	EUR Airbus SE	5 493 074	0,87	
1 767	EUR Elia Group SA/NV	200 201	0,03	21 582	EUR Alstom SA	262 869	0,04	
6 576	EUR Groupe Bruxelles Lambert NV	468 343	0,08	3 470	EUR Amundi SA	213 752	0,03	
15 976	EUR KBC Group NV	938 111	0,15	3 714	EUR Arkema SA	382 542	0,06	
26	EUR Lotus Bakeries NV	213 980	0,03	118 849	EUR AXA SA	3 504 857	0,55	
914	EUR Sofina SA	206 015	0,03	2 467	EUR BioMerieux	248 180	0,04	
4 814	EUR Syensqo SA	453 768	0,07	69 543	EUR BNP Paribas SA	4 352 696	0,69	
8 012	EUR Ucb SA	632 147	0,10	52 214	EUR Bolloré SE	295 270	0,05	
15 550	EUR Umicore SA	387 195	0,06	11 780	EUR Bouygues SA	401 934	0,06	
13 212	EUR Warehouses De Pauw CVA REIT	376 542	0,06	19 904	EUR Bureau Veritas SA	455 204	0,07	
Belgique – Total			7 853 356	1,24	10 373	EUR Capgemini SE	1 957 904	0,31
Chili				41 432	EUR Carrefour SA	686 321	0,11	
24 661	GBP Antofagasta PLC	477 978	0,08	30 570	EUR Cie de Saint-Gobain SA	2 037 796	0,32	
Chili – Total			477 978	0,08	44 772	EUR Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	1 453 299	0,23
Danemark				2 756	EUR Covivio SA REIT	134 162	0,02	
344	DKK AP Moller - Maersk A/S	560 215	0,09	73 976	EUR Credit Agricole SA	950 740	0,15	
197	DKK AP Moller - Maersk A/S	316 593	0,05	41 869	EUR Danone SA	2 456 873	0,39	
6 334	DKK Carlsberg AS	719 509	0,11	1 691	EUR Dassault Aviation SA	303 027	0,05	
6 906	DKK Chr Hansen Holding A/S	524 535	0,08	44 211	EUR Dassault Systemes SE	1 955 674	0,31	
8 775	DKK Coloplast A/S	908 745	0,14	16 202	EUR Edenred SE	877 176	0,14	
44 810	DKK Danske Bank A/S	1 084 399	0,17	4 686	EUR Eiffage SA	454 636	0,07	
7 925	DKK Demant A/S	314 680	0,05	124 170	EUR Engie SA	1 976 538	0,31	
11 985	DKK Dsv As	1 905 975	0,30	19 573	EUR EssilorLuxottica SA	3 554 457	0,56	
4 253	DKK Genmab A/S	1 229 477	0,19	2 577	EUR Eurazeo SE	185 157	0,03	
215 646	DKK Novo Nordisk A/S	20 194 667	3,19	2 961	EUR Gecina SA REIT	326 006	0,05	
13 356	DKK Novozymes A/S	664 883	0,11	21 428	EUR Getlink SE	354 955	0,06	
12 067	DKK Orsted AS	605 894	0,10	2 090	EUR Hermes International SCA	4 010 292	0,63	
5 848	DKK Pandora A/S	732 082	0,12	2 558	EUR Ipsen SA	276 008	0,04	
518	DKK ROCKWOOLAS	137 307	0,02	4 904	EUR Kering SA	1 956 696	0,31	
25 587	DKK Tryg A/S	504 219	0,08	14 137	EUR Klepierre SA REIT	348 901	0,06	
67 138	DKK Vestas Wind Systems A/S	1 930 048	0,31	5 558	EUR La Francaise des Jeux SAEM	182 525	0,03	
Danemark – Total			32 333 228	5,11	17 504	EUR Legrand SA	1 647 126	0,26
Finlande				15 926	EUR L'Oreal SA	7 177 052	1,14	
9 517	EUR Elisa OYJ	398 477	0,06	18 252	EUR LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	13 389 667	2,12	
28 571	EUR Fortum Oyj	373 137	0,06	121 058	EUR Orange SA	1 247 382	0,20	
17 812	EUR Kesko Oyj	319 280	0,05	13 491	EUR Pernod Ricard SA	2 155 187	0,34	
22 094	EUR Kone Oyj	997 765	0,16	15 805	EUR Publicis Groupe SA	1 327 620	0,21	
42 026	EUR Metso Oyj	385 379	0,06	1 735	EUR Remy Cointreau SA	199 525	0,03	
28 141	EUR Neste Oyj	906 422	0,14	12 431	EUR Renault SA	458 766	0,07	
350 114	EUR Nokia Oyj	1 068 548	0,17	22 699	EUR Safran SA	3 619 582	0,57	
211 785	EUR Nordea Bank Abp	2 377 499	0,38	75 176	EUR Sanofi SA	6 747 798	1,07	
8 901	EUR Orion Oyj	349 542	0,05	1 826	EUR Sartorius Stedim Biotech	437 327	0,07	
29 779	EUR Sampo Oyj	1 179 546	0,19	36 154	EUR Schneider Electric SE	6 572 074	1,04	

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 % (suite)			
France (suite)				Allemagne (suite)			
1 226	EUR SEB SA	138 538	0,02	9 088	EUR Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	3 408 909	0,54
47 481	EUR Societe Generale SA	1 140 731	0,18	3 252	EUR Nemetschek SE	255 217	0,04
6 425	EUR Sodexo SA	640 058	0,10	6 606	EUR Puma SE	333 735	0,05
4 371	EUR Teleperformance SE	577 191	0,09	289	EUR Rational AG	202 156	0,03
6 826	EUR Thales SA	914 343	0,15	2 875	EUR Rheinmetall AG	825 125	0,13
151 341	EUR TotalEnergies SE	9 322 606	1,47	41 678	EUR RWE AG	1 716 300	0,27
7 211	EUR Unibail-Rodamco-Westfield REIT	482 560	0,08	69 212	EUR SAP SE	9 653 690	1,53
45 240	EUR Veolia Environnement SA	1 292 054	0,21	1 671	EUR Sartorius AG—Preferred Stock	556 777	0,09
33 896	EUR Vinci SA	3 853 975	0,61	5 378	EUR Scout24 SE	345 052	0,05
39 205	EUR Vivendi SE	379 348	0,06	50 421	EUR Siemens AG	8 567 536	1,35
15 925	EUR Worldline SA	249 545	0,04	18 159	EUR Siemens Healthineers AG	955 163	0,15
France – Total		112 844 758	17,85	8 514	EUR Symrise AG	848 335	0,13
Allemagne				4 679	EUR Talanx AG	302 497	0,05
10 720	EUR adidas AG	1 974 195	0,31	48 013	EUR Vonovia SE	1 370 291	0,22
26 826	EUR Allianz SE	6 490 551	1,03	1 100	EUR Wacker Chemie AG	125 730	0,02
59 548	EUR BASF SE	2 904 751	0,46	1 100	EUR Wacker Chemie AG	125 730	0,02
65 393	EUR Bayer AG	2 199 167	0,35	17 700	EUR Zalando SE	379 665	0,06
21 285	EUR Bayerische Motoren Werke AG	2 145 102	0,34	Allemagne – Total	79 967 507	12,65	
3 664	EUR Bayerische Motoren Werke AG—Preferred Stock	329 577	0,05	Irlande			
5 910	EUR Bechtle AG	268 255	0,04	12 800	USD AerCap Holdings NV	861 174	0,14
6 564	EUR Beiersdorf AG	890 735	0,14	94 827	EUR AIB Group PLC	367 929	0,06
9 627	EUR Brenntag SE	801 159	0,13	65 851	EUR Bank of Ireland Group PLC	541 163	0,08
2 123	EUR Carl Zeiss Meditec AG	209 837	0,03	47 306	GBP CRH PLC	2 953 457	0,47
72 134	EUR Commerzbank AG	776 162	0,12	6 501	GBP DCC PLC	433 486	0,07
7 029	EUR Continental AG	540 671	0,09	11 954	EUR Flutter Entertainment PLC	1 912 640	0,30
12 239	EUR Covestro AG	644 751	0,10	10 207	EUR Kerry Group PLC	802 883	0,13
34 376	EUR Daimler Truck Holding AG	1 169 472	0,19	11 144	EUR Kingspan Group PLC	873 690	0,14
10 888	EUR Delivery Hero SE	272 309	0,04	16 815	EUR Smurfit Kappa Group PLC	603 322	0,09
128 850	EUR Deutsche Bank AG	1 593 101	0,25	Irlande – Total	9 349 744	1,48	
12 697	EUR Deutsche Boerse AG	2 367 990	0,37	Ile de Man			
35 997	EUR Deutsche Lufthansa AG	289 704	0,05	41 084	GBP Entain PLC	471 372	0,07
65 537	EUR Deutsche Post AG	2 939 662	0,47	Ile de Man – Total	471 372	0,07	
215 184	EUR Deutsche Telekom AG	4 680 252	0,74	Italie			
7 922	EUR Dr Ing hc F Porsche AG	632 968	0,10	6 789	EUR Amplifon SpA	212 767	0,03
148 007	EUR EON SE	1 798 285	0,28	66 993	EUR Assicurazioni Generali SpA	1 279 901	0,20
15 665	EUR Evonik Industries AG	289 802	0,05	84 615	EUR Banco BPM SpA	404 544	0,06
14 689	EUR Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	557 594	0,09	35 496	EUR Davide Campari-Milano NV	362 592	0,06
28 951	EUR Fresenius SE & Co KGaA	812 655	0,13	1 241	EUR DiaSorin SpA	115 711	0,02
9 961	EUR GEA Group AG	375 430	0,06	542 573	EUR Enel SpA	3 651 516	0,58
4 156	EUR Hannover Rueck SE	898 943	0,14	156 146	EUR Eni SpA	2 396 529	0,38
9 023	EUR Heidelberg Materials AG	730 322	0,12	8 335	EUR Ferrari NV	2 543 842	0,40
9 569	EUR Hellofresh SE	136 932	0,02	39 339	EUR FinecoBank Banca Fineco SpA	534 420	0,09
6 881	EUR Henkel AG & Co KGaA	447 127	0,07	24 261	EUR Infrastrutture Wireless Italiane SpA	277 788	0,04
10 964	EUR Henkel AG & Co KGaA—Preferred Stock	798 837	0,13	1 031 223	EUR Intesa Sanpaolo SpA	2 726 038	0,43
86 872	EUR Infineon Technologies AG	3 283 762	0,52	24 929	EUR Leonardo SpA	372 315	0,06
4 286	EUR Knorr-Bremse AG	252 017	0,04	35 032	EUR Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	392 534	0,06
4 510	EUR LEG Immobilien SE	357 733	0,06	13 747	EUR Moncler SpA	765 708	0,12
53 847	EUR Mercedes-Benz Group AG	3 368 130	0,53	41 845	EUR Nexi SpA	309 904	0,05
8 603	EUR Merck KGaA	1 239 692	0,20	30 921	EUR Poste Italiane SpA	317 713	0,05
3 348	EUR MTU Aero Engines AG	653 697	0,10				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 % (suite)			
Italie (suite)				Norvège (suite)			
18 927	EUR Prysmian SpA			33 220	NOK Mowi ASA	538 935	0,09
6 129	EUR Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	299 279	0,05	82 038	NOK Norsk Hydro ASA	500 192	0,08
127 814	EUR Snam SpA	594 974	0,10	46 792	NOK Orkla ASA	328 839	0,05
845 249	EUR Telecom Italia SpA/Milano	248 672	0,04	5 664	NOK Salmar ASA	287 378	0,05
92 191	EUR Terna - Rete Elettrica Nazionale	696 411	0,11	38 099	NOK Telenor ASA	395 984	0,06
105 913	EUR UniCredit SpA	2 601 753	0,41	10 025	NOK Yara International ASA	322 773	0,05
Italie – Total				Norvège – Total			
21 884 136				6 555 687			
3,46				1,04			
Jordanie				Portugal			
13 485	GBP Hikma Pharmaceuticals PLC	278 406	0,04	202 151	EUR EDP - Energias de Portugal SA	920 798	0,15
Jordanie – Total				31 443			
278 406				EUR Galp Energia SGPS SA			
0,04				419 450			
Luxembourg				18 008			
32 410	EUR ArcelorMittal SA	832 127	0,13	EUR Jeronimo Martins SGPS SA			
8 549	EUR Eurofins Scientific SE	504 220	0,08	414 904			
30 702	EUR Tenaris SA	483 403	0,08	Portugal – Total			
Luxembourg – Total				1 755 152			
1 819 750				0,28			
0,29				Afrique du Sud			
Pays-Bas				30 662			
33 232	EUR ABN AMRO Bank NV	451 623	0,07	GBP Mondi PLC			
1 463	EUR Adyen NV	1 706 736	0,27	544 042			
106 427	EUR Aegon Ltd	558 529	0,09	Afrique du Sud – Total			
11 018	EUR Akzo Nobel NV	824 367	0,13	544 042			
3 807	EUR Argenx SE	1 307 704	0,21	0,09			
3 077	EUR ASM International NV	1 446 036	0,23	Espagne			
26 661	EUR ASML Holding NV	18 174 804	2,87	2 038	EUR Acciona SA	271 665	0,04
9 825	EUR ASR Nederland NV	419 528	0,07	14 424	EUR ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	579 268	0,09
4 951	EUR BE Semiconductor Industries NV	675 564	0,11	4 918	EUR Aena SME SA	807 044	0,13
6 089	EUR Euronext NV	478 900	0,07	29 689	EUR Amadeus IT Group SA	1 926 222	0,30
6 834	EUR EXOR NV	618 477	0,10	392 970	EUR Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	3 232 571	0,51
34 022	EUR Ferrovial SE	1 123 406	0,18	1 068 116	EUR Banco Santander SA	4 036 945	0,64
8 434	EUR Heineken Holding NV	646 044	0,10	285 263	EUR CaixaBank SA	1 062 890	0,17
19 171	EUR Heineken NV	1 762 582	0,28	37 394	EUR Cellnex Telecom SA	1 333 470	0,21
3 444	EUR IMCD NV	542 602	0,09	4 300	EUR Corp ACCIONA Energias Renovables SA	120 744	0,02
239 701	EUR ING Groep NV	3 242 196	0,51	22 351	EUR EDP Renovaveis SA	414 052	0,06
7 502	EUR JDE Peet's NV	182 749	0,03	14 830	EUR Enagas SA	226 380	0,04
63 376	EUR Koninklijke Ahold Delhaize NV	1 648 727	0,26	19 619	EUR Endesa SA	362 167	0,06
232 131	EUR Koninklijke KPN NV	723 784	0,11	22 765	EUR Grifols SA	351 833	0,06
54 652	EUR Koninklijke Philips NV	1 152 337	0,18	400 948	EUR Iberdrola SA	4 759 253	0,75
18 900	EUR NN Group NV	675 675	0,11	72 173	EUR Industria de Diseno Textil SA	2 845 781	0,45
7 909	EUR OCI NV	207 532	0,03	7 327	EUR Naturgy Energy Group SA	197 829	0,03
96 925	EUR Prosus NV	2 615 521	0,41	24 689	EUR Redeia Corp SA	368 113	0,06
15 944	EUR Qiagen Nv	628 194	0,10	82 992	EUR Repsol SA	1 116 243	0,18
6 563	EUR Randstad NV	372 253	0,06	309 740	EUR Telefonica SA	1 094 621	0,17
146 257	EUR Stellantis NV	3 093 336	0,49	Espagne – Total			
16 439	EUR Wolters Kluwer NV	2 115 699	0,33	25 107 091			
Pays-Bas – Total				3,97			
47 394 905				7,49			
Norvège				Suède			
23 787	NOK Adevinta ASA	238 326	0,04	18 347	SEK Alfa Laval AB	664 826	0,11
19 199	NOK Aker BP ASA	505 710	0,08	66 672	SEK Assa Abloy AB	1 738 593	0,28
60 168	NOK DNB Bank ASA	1 158 470	0,18	180 585	SEK Atlas Copco AB	2 815 228	0,45
60 512	NOK Equinor ASA	1 737 661	0,28	101 054	SEK Atlas Copco AB	1 356 162	0,21
15 816	NOK Gjensidige Forsikring ASA	264 340	0,04	24 882	SEK Beijer Ref AB	301 512	0,05
6 679	NOK Kongsberg Gruppen ASA	277 079	0,04	20 194	SEK Boliden AB	570 493	0,09
				43 410	SEK Epiroc AB	788 458	0,12
				23 218	SEK Epiroc AB	367 901	0,06
				23 276	SEK EQT AB	595 882	0,09
				39 821	SEK Essity AB	894 251	0,14
				12 002	SEK Evolution AB	1 296 098	0,21
				55 356	SEK Fastighets AB Balder	355 631	0,06

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 % (suite)			
Suède (suite)				Suisse (suite)			
17 133	SEK Getinge AB	345 199	0,05	2 300	CHF Helvetia Holding AG	286 718	0,05
44 929	SEK H & M Hennes & Mauritz AB	712 810	0,11	34 561	CHF Holcim AG	2 454 175	0,39
138 107	SEK Hexagon AB	1 500 476	0,24	13 562	CHF Julius Baer Group Ltd	687 779	0,11
4 962	SEK Holmen AB	189 744	0,03	3 566	CHF Kuehne & Nagel International AG	1 111 536	0,18
22 174	SEK Husqvarna AB	165 282	0,03	10 631	CHF Logitech International SA	912 017	0,14
11 532	SEK Industrivarden AB	340 081	0,05	5 003	CHF Lonza Group AG	1 903 309	0,30
7 287	SEK Industrivarden AB	215 288	0,03	176 769	CHF Nestle SA	18 539 541	2,93
19 630	SEK Indutrade AB	461 633	0,07	135 445	CHF Novartis AG	12 364 054	1,95
11 817	SEK Investment AB Latour	278 428	0,04	1 499	CHF Partners Group Holding AG	1 955 718	0,31
112 744	SEK Investor AB	2 364 763	0,37	46 583	CHF Roche Holding AG	12 250 393	1,94
4 203	SEK L E Lundbergforetagen AB	206 969	0,03	2 020	CHF Roche Holding AG	567 938	0,09
13 663	SEK Lifco AB	303 390	0,05	28 582	CHF Sandoz Group AG	831 887	0,13
94 594	SEK Nibe Industrier AB	601 595	0,10	2 768	CHF Schindler Holding AG	626 108	0,10
5 000	SEK Saab AB	272 895	0,04	1 426	CHF Schindler Holding AG	305 989	0,05
12 364	SEK Sagax AB	308 087	0,05	9 606	CHF SGS SA	749 487	0,12
70 531	SEK Sandvik AB	1 381 793	0,22	32 887	EUR Siemens Energy AG	394 644	0,06
29 683	SEK Securitas AB	262 848	0,04	21 400	CHF SIG Group AG	445 388	0,07
102 471	SEK Skandinaviska Enskilda Banken AB	1 277 608	0,20	10 187	CHF Sika AG	2 998 920	0,47
21 761	SEK Skanska AB	356 445	0,06	3 345	CHF Sonova Holding AG	987 243	0,16
24 943	SEK SKF AB	451 024	0,07	46 346	EUR STMicroelectronics NV	2 096 925	0,33
40 795	SEK Svenska Cellulosa AB SCA	553 705	0,09	7 294	CHF Straumann Holding AG	1 063 822	0,17
95 565	SEK Svenska Handelsbanken AB	939 555	0,15	1 997	CHF Swatch Group AG	491 019	0,08
55 943	SEK Swedbank AB	1 021 623	0,16	3 343	CHF Swatch Group AG	158 389	0,02
12 148	SEK Swedish Orphan Biovitrum AB	291 356	0,05	1 937	CHF Swiss Life Holding AG	1 216 707	0,19
31 488	SEK Tele2 AB	244 776	0,04	5 888	CHF Swiss Prime Site AG	569 023	0,09
192 972	SEK Telefonaktiebolaget LM Ericsson	1 093 956	0,17	19 923	CHF Swiss Re AG	2 026 310	0,32
160 082	SEK Telia Co AB	369 990	0,06	1 663	CHF Swisscom AG	905 079	0,14
97 808	SEK Volvo AB	2 299 246	0,36	4 210	CHF Temenos AG	354 196	0,06
15 109	SEK Volvo AB	362 372	0,06	217 489	CHF UBS Group AG	6 105 504	0,97
31 128	SEK Volvo Car AB	91 042	0,01	1 862	CHF VAT Group AG	844 153	0,13
				9 666	CHF Zurich Insurance Group AG	4 570 337	0,72
Suède – Total		31 009 014	4,90	Suisse – Total		100 741 883	15,93
Suisse				Royaume-Uni			
106 862	CHF ABB Ltd	4 287 221	0,68	63 962	GBP 3i Group PLC	1 787 039	0,28
10 121	CHF Adecco Group AG	449 264	0,07	123 137	GBP abrdn PLC	253 868	0,04
33 223	CHF Alcon Inc	2 345 585	0,37	16 366	GBP Admiral Group PLC	506 923	0,08
8 299	CHF Avolta AG	295 281	0,05	84 269	GBP Anglo American PLC	1 916 388	0,30
2 190	CHF Bachem Holding AG	153 109	0,02	28 841	GBP Ashtead Group PLC	1 817 939	0,29
3 119	CHF Baloise Holding AG	442 155	0,07	22 623	GBP Associated British Foods PLC	617 967	0,10
1 555	CHF Banque Cantonale Vaudoise	181 470	0,03	102 518	GBP Astrazeneca PLC	12 540 740	1,98
230	CHF Barry Callebaut AG	351 038	0,06	60 059	GBP Auto Trader Group PLC	500 002	0,08
1 200	CHF BKW AG	192 959	0,03	176 762	GBP Aviva PLC	886 739	0,14
62	CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	672 863	0,11	202 095	GBP BAE Systems PLC	2 589 950	0,41
7	CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	767 966	0,12	1 005 891	GBP Barclays PLC	1 785 122	0,28
34 629	CHF Cie Financiere Richemont SA	4 311 264	0,68	64 406	GBP Barratt Developments PLC	418 161	0,07
11 804	CHF Clariant AG	157 686	0,02	6 461	GBP Berkeley Group Holdings PLC	349 546	0,06
13 591	GBP Coca-Cola HBC AG	361 526	0,06	1 129 286	GBP BP PLC	6 075 007	0,96
12 329	EUR DSM-Firmenich AG	1 134 268	0,18	140 878	GBP British American Tobacco PLC	3 731 966	0,59
393	CHF EMS-Chemie Holding AG	287 861	0,05	414 199	GBP BT Group PLC	590 806	0,09
2 219	CHF Geberit AG	1 286 441	0,20	21 776	GBP Bunzl PLC	801 652	0,13
611	CHF Givaudan SA	2 289 618	0,36	27 080	GBP Burberry Group PLC	442 516	0,07
				384 412	GBP Centrica PLC	623 956	0,10

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,38 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
14 079 USD	Coca-Cola Europacific Partners PLC	850 615	0,13	47 664 GBP	Reckitt Benckiser Group PLC	2 981 309	0,47
				125 722 GBP	RELX PLC	4 512 205	0,71
112 914 GBP	Compass Group PLC	2 796 370	0,44	158 957 GBP	Rentokil Initial PLC	808 609	0,13
9 560 GBP	Croda International PLC	557 143	0,09	74 751 GBP	Rio Tinto PLC	5 039 596	0,80
147 194 GBP	Diageo PLC	4 851 382	0,77	556 293 GBP	Rolls-Royce Holdings PLC	1 924 011	0,30
12 300 GBP	Endeavour Mining PLC	249 399	0,04	71 682 GBP	Sage Group PLC	969 929	0,15
60 962 GBP	Experian PLC	2 252 671	0,36	46 892 GBP	Schroders PLC	232 639	0,04
270 914 GBP	GSK PLC	4 533 948	0,72	79 485 GBP	Segro PLC REIT	813 078	0,13
386 775 GBP	Haleon PLC	1 435 685	0,23	16 966 GBP	Severn Trent PLC	504 950	0,08
23 257 GBP	Halma PLC	613 009	0,10	437 487 GBP	Shell PLC	12 982 815	2,05
19 913 GBP	Hargreaves Lansdown PLC	168 675	0,03	56 009 GBP	Smith & Nephew PLC	697 100	0,11
1 288 506 GBP	HSBC Holdings PLC	9 449 725	1,49	24 791 GBP	Smiths Group PLC	504 530	0,08
56 816 GBP	Imperial Brands PLC	1 184 475	0,19	4 637 GBP	Spirax-Sarco Engineering PLC	562 148	0,09
90 875 GBP	Informa PLC	819 264	0,13	72 665 GBP	SSE PLC	1 556 397	0,25
11 434 GBP	InterContinental Hotels Group PLC	935 538	0,15	38 858 GBP	St James's Place PLC	306 549	0,05
10 888 GBP	Intertek Group PLC	533 513	0,08	151 701 GBP	Standard Chartered PLC	1 167 000	0,18
104 699 GBP	J Sainsbury PLC	365 619	0,06	223 883 GBP	Taylor Wimpey PLC	379 930	0,06
169 375 GBP	JD Sports Fashion PLC	324 372	0,05	476 321 GBP	Tesco PLC	1 596 846	0,25
119 325 GBP	Kingfisher PLC	335 035	0,05	165 617 GBP	Unilever PLC	7 262 827	1,15
43 353 GBP	Land Securities Group PLC REIT	352 616	0,06	44 397 GBP	United Utilities Group PLC	542 840	0,09
393 839 GBP	Legal & General Group PLC	1 141 255	0,18	1 514 969 GBP	Vodafone Group PLC	1 198 648	0,19
4 238 499 GBP	Lloyds Banking Group PLC	2 333 666	0,37	12 746 GBP	Whitbread PLC	537 771	0,08
27 544 GBP	London Stock Exchange Group PLC	2 947 890	0,47	45 422 GBP	Wise PLC	458 136	0,07
				69 256 GBP	Wpp PLC	601 824	0,09
				Royaume-Uni – Total		134 376 213	21,25
162 112 GBP	M&G PLC	416 071	0,07	États-Unis			
86 792 GBP	Melrose Industries PLC	568 311	0,09	53 268 EUR	Universal Music Group NV	1 374 847	0,22
245 847 GBP	National Grid PLC	3 001 703	0,47	États-Unis – Total			
377 642 GBP	NatWest Group PLC	956 168	0,15			1 374 847	0,22
7 648 GBP	Next PLC	716 497	0,11	Total des actions ordinaires et préférentielles			
41 140 GBP	Ocado Group PLC	360 064	0,06			628 406 192	99,38
40 796 GBP	Pearson PLC	453 944	0,07	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
21 217 GBP	Persimmon PLC	340 097	0,05			628 406 192	99,38
45 408 GBP	Phoenix Group Holdings PLC	280 457	0,04	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
182 942 GBP	Prudential PLC	1 873 062	0,30			628 406 192	99,38

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,00 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Moins-values latentes	% des actifs nets
FTSE 100 INDEX FUTURE, due 15/03/24	GBP	6	537 074	10 790	0,00
SWISS MARKET INDEX FUTURE, due 15/03/24	CHF	3	357 556	1 226	0,00
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			894 630	12 016	0,00

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Produits dérivés (suite)

Contrats à terme standardisés – 0,00 % (suite)

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Moins-values latentes	% des actifs nets
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE, due 15/03/24	EUR	26	1 181 180	(8 657)	(0,00)
Moins-values latentes sur contrats à terme standardisés			1 181 180	(8 657)	(0,00)
Total des contrats à terme standardisés			2 075 810	3 359	0,00
Autres actifs/(passifs) nets				3 944 036	0,62
TOTAL DES ACTIFS NETS				632 353 587	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 130 580 EUR détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,22 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,22 % (<i>suite</i>)			
Australie				Australie (<i>suite</i>)			
9 207	AUD Ampol Ltd	227 109	0,34	6 535	AUD WiseTech Global Ltd	336 087	0,50
119 119	AUD ANZ Group Holdings Ltd	2 106 799	3,16	75 731	AUD Woodside Energy Group Ltd	1 605 026	2,41
52 082	AUD APA Group	303 496	0,45	48 315	AUD Woolworths Group Ltd	1 226 400	1,84
23 360	AUD Aristocrat Leisure Ltd	650 658	0,98	Australie – Total			
7 603	AUD ASX Ltd	327 149	0,49	39 697 881 59,50			
75 911	AUD Aurizon Holdings Ltd	196 832	0,29	Îles Caïmans			
17 648	AUD BlueScope Steel Ltd	281 785	0,42	79 200	USD Grab Holdings Ltd	266 904	0,40
55 353	AUD Brambles Ltd	513 673	0,77	70 000	HKD Wharf Real Estate Investment Co Ltd	236 664	0,35
14 006	AUD CAR Group Ltd	297 605	0,45	Îles Caïmans – Total			
2 595	AUD Cochlear Ltd	528 854	0,79	503 568 0,75			
52 628	AUD Coles Group Ltd	578 521	0,87	Hong Kong			
66 559	AUD Commonwealth Bank of Australia	5 077 567	7,61	455 400	HKD AIA Group Ltd	3 968 723	5,95
21 346	AUD Computershare Ltd	355 251	0,53	147 000	HKD BOC Hong Kong Holdings Ltd	399 101	0,60
19 287	AUD CSL Ltd	3 772 452	5,65	70 700	HKD Budweiser Brewing Co APAC Ltd	132 372	0,20
41 590	AUD Dexus REIT	217 950	0,33	77 506	HKD CK Asset Holdings Ltd	389 091	0,58
6 138	NZD EBOS Group Ltd	137 963	0,21	105 500	HKD CK Hutchison Holdings Ltd	565 428	0,85
53 894	AUD Endeavour Group Ltd	191 595	0,29	23 500	HKD CK Infrastructure Holdings Ltd	130 011	0,20
67 072	AUD Fortescue Ltd	1 328 146	1,99	65 500	HKD CLP Holdings Ltd	540 622	0,81
68 173	AUD Goodman Group REIT	1 176 901	1,76	93 300	HKD ESR Group Ltd	129 043	0,19
74 504	AUD GPT Group REIT	235 887	0,35	2 060	USD Futu Holdings Ltd	112 538	0,17
10 589	AUD IDP Education Ltd	144 725	0,22	86 000	HKD Galaxy Entertainment Group Ltd	481 844	0,72
27 826	AUD IGO Ltd	171 833	0,26	64 000	HKD Hang Lung Properties Ltd	89 174	0,13
95 303	AUD Insurance Australia Group Ltd	368 070	0,55	30 400	HKD Hang Seng Bank Ltd	354 473	0,53
87 137	AUD Lottery Corp Ltd	287 776	0,43	59 318	HKD Henderson Land Development Co Ltd	182 697	0,27
14 563	AUD Macquarie Group Ltd	1 824 742	2,73	145 000	HKD HKT Trust & HKT Ltd	173 067	0,26
113 304	AUD Medibank Pvt Ltd	275 234	0,41	465 775	HKD Hong Kong & China Gas Co Ltd	356 703	0,54
7 268	AUD Mineral Resources Ltd	347 152	0,52	47 823	HKD Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	1 641 350	2,46
148 111	AUD Mirvac Group REIT	211 223	0,32	45 600	USD Hongkong Land Holdings Ltd	158 688	0,24
124 198	AUD National Australia Bank Ltd	2 601 717	3,90	6 170	USD Jardine Matheson Holdings Ltd	254 266	0,38
45 992	AUD Northern Star Resources Ltd	428 373	0,64	101 271	HKD Link REIT	568 701	0,85
17 337	AUD Orica Ltd	188 569	0,28	59 684	HKD MTR Corp Ltd	231 596	0,35
68 353	AUD Origin Energy Ltd	395 046	0,59	63 212	HKD New World Development Co Ltd	98 114	0,15
111 712	AUD Pilbara Minerals Ltd	301 095	0,45	54 500	HKD Power Assets Holdings Ltd	315 824	0,47
36 101	AUD Qantas Airways Ltd	132 282	0,20	140 115	HKD Sino Land Co Ltd	152 343	0,23
59 787	AUD QBE Insurance Group Ltd	604 184	0,91	59 200	HKD SITC International Holdings Co Ltd	102 198	0,15
7 157	AUD Ramsay Health Care Ltd	256 925	0,39	57 500	HKD Sun Hung Kai Properties Ltd	621 866	0,93
2 211	AUD REA Group Ltd	273 297	0,41	18 000	HKD Swire Pacific Ltd	152 371	0,23
8 326	AUD Reece Ltd	127 203	0,19	52 200	HKD Swire Properties Ltd	105 623	0,16
127 855	AUD Santos Ltd	663 038	0,99	54 500	HKD Techtronic Industries Co Ltd	649 445	0,97
208 720	AUD Scentre Group REIT	425 836	0,64	321 300	HKD WH Group Ltd	207 382	0,31
14 969	AUD SEEK Ltd	273 023	0,41	41 000	HKD Wharf Holdings Ltd	132 054	0,20
18 036	AUD Sonic Healthcare Ltd	394 804	0,59	64 699	HKD Xinyi Glass Holdings Ltd	72 582	0,11
179 506	AUD South32 Ltd	407 878	0,61	Hong-Kong – Total			
94 716	AUD Stockland REIT	287 601	0,43	13 469 290 20,19			
50 836	AUD Suncorp Group Ltd	480 428	0,72	Irlande			
159 378	AUD Telstra Group Ltd	430 656	0,65	17 312	AUD James Hardie Industries PLC	667 307	1,00
122 072	AUD Transurban Group	1 141 985	1,71	Irlande – Total			
33 113	AUD Treasury Wine Estates Ltd	243 570	0,37	667 307 1,00			
149 356	AUD Vicinity Ltd REIT	207 903	0,31	Macao			
8 940	AUD Washington H Soul Pattinson & Co Ltd	199 904	0,30	93 300	HKD Sands China Ltd	273 022	0,41
45 033	AUD Wesfarmers Ltd	1 752 740	2,63	Macao – Total			
139 216	AUD Westpac Banking Corp	2 175 363	3,26	273 022 0,41			

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Actions ordinaires et préférentielles – 99,22 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,22 % (suite)					
Nouvelle-Zélande				Singapour (suite)					
51 872	NZD Auckland International Airport Ltd	289 016	0,43	14 530	USD Sea Ltd	588 465	0,88		
23 330	NZD Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	348 605	0,52	1 675 000	SGD Seatrium Ltd	149 837	0,23		
25 329	NZD Mercury NZ Ltd	105 844	0,16	33 900	SGD Sembcorp Industries Ltd	136 464	0,21		
53 546	NZD Meridian Energy Ltd	187 821	0,28	61 749	SGD Singapore Airlines Ltd	307 083	0,46		
72 723	NZD Spark New Zealand Ltd	238 511	0,36	33 400	SGD Singapore Exchange Ltd	248 898	0,37		
5 680	AUD Xero Ltd	435 246	0,65	64 800	SGD Singapore Technologies Engineering Ltd	191 094	0,29		
Nouvelle-Zélande – Total			2,40	325 100	SGD Singapore Telecommunications Ltd	608 746	0,91		
Singapour				50 147	SGD United Overseas Bank Ltd	1 081 557	1,62		
148 115	SGD CapitaLand Ascendas REIT	340 223	0,51	18 720	SGD UOL Group Ltd	89 123	0,13		
207 521	SGD CapitaLand Integrated Commercial Trust REIT	324 079	0,49	80 000	SGD Wilmar International Ltd	216 511	0,32		
103 267	SGD Capitaland Investment Ltd/Singapore	247 384	0,37	Singapour – Total			8 625 878	12,93	
18 600	SGD City Developments Ltd	93 768	0,14	Royaume-Uni					
71 737	SGD DBS Group Holdings Ltd	1 816 946	2,72	14 707	AUD Rio Tinto Ltd	1 361 391	2,04		
232 400	SGD Genting Singapore Ltd	176 181	0,26	Royaume-Uni – Total			1 361 391	2,04	
3 900	SGD Jardine Cycle & Carriage Ltd	87 987	0,13	Total des actions ordinaires et préférentielles			66 203 380	99,22	
56 700	SGD Keppel Corp Ltd	303 896	0,46	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				66 203 380	99,22
131 004	SGD Mapletree Logistics Trust REIT	172 805	0,26	TOTAL DES INVESTISSEMENTS				66 203 380	99,22
101 200	SGD Mapletree Pan Asia Commercial Trust REIT	120 449	0,18						
134 384	SGD Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	1 324 382	1,99						

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,02 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
HANG SENG INDEX FUTURE, due 30/01/24	HKD	2	219 401	8 113	0,01
SPI 200 FUTURE, due 21/03/24	AUD	2	258 781	3 685	0,01
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			478 182	11 798	0,02
Total des contrats à terme standardisés			478 182	11 798	0,02
Autres actifs/(passifs) nets				507 584	0,76
TOTAL DES ACTIFS NETS				66 722 762	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 41 619 USD détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % <i>(suite)</i>			
Argentine				Australie <i>(suite)</i>			
3 697	USD MercadoLibre Inc	5 809 983	0,12	310 268	AUD Vicinity Ltd REIT	431 891	0,01
Argentine – Total				22 891	AUD Washington H Soul Pattinson & Co Ltd	511 857	0,01
Australie				94 230	AUD Wesfarmers Ltd	3 667 548	0,08
22 940	AUD Ampol Ltd	565 860	0,01	273 426	AUD Westpac Banking Corp	4 272 503	0,09
250 857	AUD ANZ Group Holdings Ltd	4 436 784	0,09	12 961	AUD WiseTech Global Ltd	666 567	0,01
119 560	AUD APA Group	696 708	0,01	128 457	AUD Woodside Energy Group Ltd	2 722 490	0,06
51 141	AUD Aristocrat Leisure Ltd	1 424 457	0,03	90 041	AUD Woolworths Group Ltd	2 285 548	0,05
16 872	AUD ASX Ltd	725 985	0,02	Australie – Total			
12 800	USD Atlassian Corp	3 044 608	0,07	80 396 203		1,72	
180 319	AUD Aurizon Holdings Ltd	467 554	0,01	Autriche			
42 249	AUD BlueScope Steel Ltd	674 589	0,01	28 816	EUR Erste Group Bank AG	1 169 174	0,03
89 795	AUD Brambles Ltd	833 294	0,02	13 081	EUR OMV AG	574 674	0,01
29 529	AUD CAR Group Ltd	627 443	0,01	6 145	EUR Verbund AG	570 538	0,01
5 783	AUD Cochlear Ltd	1 178 560	0,03	10 983	EUR voestalpine AG	346 500	0,01
103 391	AUD Coles Group Ltd	1 136 542	0,02	Autriche – Total			
128 505	AUD Commonwealth Bank of Australia	9 803 223	0,21	2 660 886		0,06	
46 714	AUD Computershare Ltd	777 438	0,02	Belgique			
37 569	AUD CSL Ltd	7 348 330	0,16	13 102	EUR Ageas SA/NV	568 939	0,01
104 367	AUD Dexus REIT	546 930	0,01	64 260	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV	4 146 933	0,09
14 474	NZD EBOS Group Ltd	325 329	0,01	2 174	EUR D'ieteren Group	424 827	0,01
76 171	AUD Endeavour Group Ltd	270 791	0,01	2 662	EUR Elia Group SA/NV	333 168	0,01
125 422	AUD Fortescue Ltd	2 483 580	0,05	5 539	EUR Groupe Bruxelles Lambert NV	435 771	0,01
109 608	AUD Goodman Group REIT	1 892 212	0,04	21 777	EUR KBC Group NV	1 412 566	0,03
163 862	AUD GPT Group REIT	518 804	0,01	1 013	EUR Sofina SA	252 225	0,01
13 077	AUD IDP Education Ltd	178 729	0,00	6 359	EUR Syensqo SA	662 126	0,01
60 172	AUD IGO Ltd	371 578	0,01	11 349	EUR Ucb SA	989 144	0,02
212 479	AUD Insurance Australia Group Ltd	820 615	0,02	18 287	EUR Umicore SA	502 998	0,01
197 002	AUD Lottery Corp Ltd	650 613	0,01	18 308	EUR Warehouses De Pauw CVA REIT	576 382	0,01
26 649	AUD Macquarie Group Ltd	3 339 117	0,07	Belgique – Total			
256 780	AUD Medibank Pvt Ltd	623 761	0,01	10 305 079		0,22	
12 141	AUD Mineral Resources Ltd	579 909	0,01	Bermudes			
380 626	AUD Mirvac Group REIT	542 815	0,01	31 267	USD Arch Capital Group Ltd	2 322 200	0,05
243 343	AUD National Australia Bank Ltd	5 097 583	0,11	3 178	USD Everest Group Ltd	1 123 677	0,02
81 785	AUD Northern Star Resources Ltd	761 752	0,02	11 512	USD Liberty Global Ltd	214 584	0,01
7 598	AUD Orica Ltd	82 641	0,00	Bermudes – Total			
104 341	AUD Origin Energy Ltd	603 039	0,01	3 660 461		0,08	
223 989	AUD Pilbara Minerals Ltd	603 713	0,01	Canada			
80 762	AUD Qantas Airways Ltd	295 930	0,01	39 757	CAD Agnico Eagle Mines Ltd	2 190 464	0,05
125 087	AUD QBE Insurance Group Ltd	1 264 079	0,03	14 809	CAD Air Canada	209 905	0,00
14 348	AUD Ramsay Health Care Ltd	515 071	0,01	60 099	CAD Algonquin Power & Utilities Corp	381 031	0,01
5 272	AUD REA Group Ltd	651 660	0,01	61 771	CAD Alimentation Couche-Tard Inc	3 655 385	0,08
16 336	AUD Reece Ltd	249 578	0,01	25 803	CAD AltaGas Ltd	544 395	0,01
163 747	AUD Santos Ltd	849 169	0,02	53 600	CAD ARC Resources Ltd	799 569	0,02
437 554	AUD Scentre Group REIT	892 709	0,02	54 504	CAD Bank of Montreal	5 419 399	0,12
28 664	AUD SEEK Ltd	522 809	0,01	98 987	CAD Bank of Nova Scotia	4 842 000	0,10
38 385	AUD Sonic Healthcare Ltd	840 239	0,02	7 478	CAD BCE Inc	295 865	0,01
395 134	AUD South32 Ltd	897 833	0,02	21 300	CAD Brookfield Asset Management Ltd	859 689	0,02
204 399	AUD Stockland REIT	620 649	0,01	110 130	CAD Brookfield Corp	4 439 109	0,09
80 375	AUD Suncorp Group Ltd	759 588	0,02	3 300	CAD BRP Inc	237 302	0,00
336 720	AUD Telstra Group Ltd	909 853	0,02	30 501	CAD CAE Inc	661 557	0,01
245 912	AUD Transurban Group	2 300 511	0,05	36 590	CAD Cameco Corp	1 585 308	0,03
31 708	AUD Treasury Wine Estates Ltd	233 235	0,01	8 793	CAD Canadian Apartment Properties REIT	325 420	0,01
				66 828	CAD Canadian Imperial Bank of Commerce	3 233 449	0,07

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				
Canada (suite)				Canada (suite)				
40 693	CAD Canadian National Railway Co	5 139 860	0,11	24 506	CAD Rogers Communications Inc	1 152 819	0,02	
89 419	CAD Canadian Natural Resources Ltd	5 886 898	0,13	105 289	CAD Royal Bank of Canada	10 699 777	0,23	
68 058	CAD Canadian Pacific Kansas City Ltd	5 411 194	0,12	24 624	CAD Saputo Inc	501 033	0,01	
5 293	CAD Canadian Tire Corp Ltd	564 865	0,01	93 530	CAD Shopify Inc	7 317 272	0,16	
9 863	CAD Canadian Utilities Ltd	238 534	0,01	10 100	CAD Stantec Inc	814 832	0,02	
11 770	CAD CCL Industries Inc	531 908	0,01	46 930	CAD Sun Life Financial Inc	2 445 798	0,05	
119 404	CAD Cenovus Energy Inc	1 999 424	0,04	90 791	CAD Suncor Energy Inc	2 922 856	0,06	
14 151	CAD CGI Inc	1 523 384	0,03	79 064	CAD TC Energy Corp	3 103 559	0,07	
1 608	CAD Constellation Software Inc	4 006 305	0,09	30 304	CAD Teck Resources Ltd	1 287 219	0,03	
7 500	CAD Descartes Systems Group Inc	633 228	0,01	39 560	CAD Telus Corp	707 436	0,02	
22 942	CAD Dollarama Inc	1 661 407	0,04	2 980	CAD Telus Corp	53 290	0,00	
34 800	CAD Element Fleet Management Corp	569 004	0,01	6 300	CAD TFI International Inc	861 150	0,02	
22 637	CAD Emera Inc	863 523	0,02	13 177	CAD Thomson Reuters Corp	1 935 978	0,04	
13 363	CAD Empire Co Ltd	355 205	0,01	20 290	CAD Tmx Group Ltd	493 170	0,01	
165 335	CAD Enbridge Inc	5 980 949	0,13	7 500	CAD Toromont Industries Ltd	660 360	0,01	
1 506	CAD Fairfax Financial Holdings Ltd	1 396 254	0,03	138 429	CAD Toronto-Dominion Bank	8 988 542	0,19	
48 025	CAD First Quantum Minerals Ltd	395 170	0,01	27 800	CAD Tourmaline Oil Corp	1 256 334	0,03	
3 800	CAD Firstservice Corp	618 588	0,01	19 324	USD Waste Connections Inc	2 884 494	0,06	
27 387	CAD Fortis Inc	1 132 159	0,02	5 491	CAD West Fraser Timber Co Ltd	472 061	0,01	
12 835	CAD Franco-Nevada Corp	1 428 631	0,03	31 212	CAD Wheaton Precious Metals Corp	1 547 345	0,03	
5 561	CAD George Weston Ltd	693 754	0,01	10 700	CAD WSP Global Inc	1 507 218	0,03	
15 700	CAD GFL Environmental Inc	544 249	0,01	Canada – Total			155 720 708	3,33
16 525	CAD Gildan Activewear Inc	549 162	0,01	Îles Caïmans				
24 003	CAD Great-West Lifeco Inc	798 401	0,02	123 500	USD Grab Holdings Ltd	416 195	0,01	
28 435	CAD Hydro One Ltd	856 112	0,02	136 577	HKD Wharf Real Estate Investment Co Ltd	461 754	0,01	
7 760	CAD iA Financial Corp Inc	531 595	0,01	Îles Caïmans – Total			877 949	0,02
6 018	CAD IGM Financial Inc	159 783	0,00	Chili				
17 312	CAD Imperial Oil Ltd	990 983	0,02	25 802	GBP Antofagasta PLC	552 427	0,01	
13 821	CAD Intact Financial Corp	2 136 773	0,05	Chili – Total			552 427	0,01
58 600	CAD Ivanhoe Mines Ltd	571 068	0,01	Danemark				
19 406	CAD Keyera Corp	471 390	0,01	337	DKK AP Moller - Maersk A/S	606 249	0,01	
111 971	CAD Kinross Gold Corp	681 031	0,01	243	DKK AP Moller - Maersk A/S	431 385	0,01	
13 085	CAD Loblaw Cos Ltd	1 272 974	0,03	8 738	DKK Carlsberg AS	1 096 466	0,02	
8 532	USD Lululemon Athletica Inc	4 362 326	0,09	6 168	DKK Chr Hansen Holding A/S	517 508	0,01	
58 805	CAD Lundin Mining Corp	483 427	0,01	10 344	DKK Coloplast A/S	1 183 336	0,02	
23 986	CAD Magna International Inc	1 424 135	0,03	55 534	DKK Danske Bank A/S	1 484 560	0,03	
141 818	CAD Manulife Financial Corp	3 149 121	0,07	7 475	DKK Demant A/S	327 873	0,01	
18 007	CAD Metro Inc/CN REIT	936 675	0,02	13 079	DKK Dsv As	2 297 622	0,05	
26 303	CAD National Bank of Canada	2 014 715	0,04	5 614	DKK Genmab A/S	1 792 760	0,04	
21 817	CAD Northland Power Inc	398 252	0,01	253 797	DKK Novo Nordisk A/S	26 254 668	0,56	
37 275	CAD Nutrien Ltd	2 110 252	0,05	16 849	DKK Novozymes A/S	926 547	0,02	
5 905	CAD ONEX Corp	414 371	0,01	16 293	DKK Orsted AS	903 698	0,02	
15 540	CAD Open Text Corp	656 319	0,01	7 260	DKK Pandora A/S	1 003 954	0,02	
22 500	USD Ovintiv Inc	988 200	0,02	899	DKK ROCKWOOLAS	263 238	0,01	
21 376	CAD Pan American Silver Corp	350 647	0,01	33 002	DKK Tryg A/S	718 397	0,02	
12 555	CAD Parkland Corp	406 662	0,01	74 939	DKK Vestas Wind Systems A/S	2 379 756	0,05	
48 390	CAD Pembina Pipeline Corp	1 674 163	0,04	Danemark – Total			42 188 017	0,90
43 231	CAD Power Corp of Canada	1 242 244	0,03	Finlande				
14 986	CAD Quebecor Inc	358 227	0,01	12 768	EUR Elisa OYJ	590 542	0,01	
15 339	CAD RB Global Inc	1 031 480	0,02	40 410	EUR Fortum Oyj	582 984	0,01	
21 516	CAD Restaurant Brands International Inc	1 689 331	0,04	23 432	EUR Kesko Oyj	463 974	0,01	
10 198	CAD RioCanREIT	144 006	0,00					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
Finlande (suite)				France (suite)			
22 630	EUR Kone Oyj	1 128 920	0,03	15 272	EUR Publicis Groupe SA	1 417 098	0,03
58 547	EUR Metso Oyj	593 060	0,01	1 484	EUR Remy Cointreau SA	188 520	0,00
35 813	EUR Neste Oyj	1 274 254	0,03	16 956	EUR Renault SA	691 247	0,01
456 943	EUR Nokia Oyj	1 540 534	0,03	27 005	EUR Safran SA	4 756 863	0,10
242 948	EUR Nordea Bank Abp	3 012 750	0,07	85 089	EUR Sanofi SA	8 436 863	0,18
8 893	EUR Orion Oyj	385 775	0,01	51	EUR Sartorius Stedim Biotech	13 493	0,00
33 709	EUR Sampo Oyj	1 474 944	0,03	42 323	EUR Schneider Electric SE	8 498 598	0,18
46 045	EUR Stora Enso OYJ	637 067	0,01	1 579	EUR SEB SA	197 099	0,00
35 175	EUR UPM-Kymmene Oyj	1 323 438	0,03	50 659	EUR Societe Generale SA	1 344 450	0,03
30 520	EUR Wartsila OYJ Abp	442 495	0,01	6 543	EUR Sodexo SA	720 026	0,01
Finlande – Total		13 450 737	0,29	5 160	EUR Teleperformance SE	752 684	0,02
France				8 783	EUR Thales SA	1 299 602	0,03
12 077	EUR Accor SA	461 594	0,01	178 224	EUR TotalEnergies SE	12 127 510	0,26
2 670	EUR Aeroports de Paris SA	345 672	0,01	10 785	EUR Unibail-Rodamco-Westfield REIT	797 262	0,02
40 732	EUR Air Liquide SA	7 924 451	0,17	45 640	EUR Veolia Environnement SA	1 439 888	0,03
47 487	EUR Airbus SE	7 332 372	0,16	37 981	EUR Vinci SA	4 770 365	0,10
22 145	EUR Alstom SA	297 953	0,01	30 028	EUR Vivendi SE	320 957	0,01
5 288	EUR Amundi SA	359 830	0,01	22 179	EUR Worldline SA	383 916	0,01
5 276	EUR Arkema SA	600 298	0,01	France – Total		146 556 777	3,14
143 345	EUR AXA SA	4 669 626	0,10	Allemagne			
3 814	EUR BioMerieux	423 841	0,01	11 776	EUR adidas AG	2 395 620	0,05
81 696	EUR BNP Paribas SA	5 648 466	0,12	30 490	EUR Allianz SE	8 149 065	0,17
77 243	EUR Bolloré SE	482 521	0,01	69 286	EUR BASF SE	3 733 465	0,08
17 366	EUR Bouygues SA	654 536	0,01	81 370	EUR Bayer AG	3 022 845	0,07
26 483	EUR Bureau Veritas SA	669 049	0,01	26 948	EUR Bayerische Motoren Werke AG	3 000 030	0,06
11 980	EUR Capgemini SE	2 497 862	0,05	5 269	EUR Bayerische Motoren Werke AG–Preferred Stock	523 545	0,01
50 805	EUR Carrefour SA	929 657	0,02	6 933	EUR Bechtle AG	347 621	0,01
36 305	EUR Cie de Saint-Gobain SA	2 673 354	0,06	6 798	EUR Beiersdorf AG	1 019 027	0,02
48 775	EUR Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	1 748 922	0,04	12 285	EUR Brenntag SE	1 129 348	0,02
4 858	EUR Covivio SA REIT	261 236	0,01	3 913	EUR Carl Zeiss Meditec AG	427 236	0,01
91 792	EUR Credit Agricole SA	1 303 168	0,03	89 130	EUR Commerzbank AG	1 059 402	0,02
54 156	EUR Danone SA	3 510 439	0,07	10 116	EUR Continental AG	859 553	0,02
2 001	EUR Dassault Aviation SA	396 105	0,01	15 077	EUR Covestro AG	877 375	0,02
55 619	EUR Dassault Systemes SE	2 717 778	0,06	38 952	EUR Daimler Truck Holding AG	1 463 824	0,03
16 289	EUR Edenred SE	974 176	0,02	14 653	EUR Delivery Hero SE	404 823	0,01
5 613	EUR Eiffage SA	601 563	0,01	134 169	EUR Deutsche Bank AG	1 832 466	0,04
133 639	EUR Engie SA	2 349 884	0,05	13 921	EUR Deutsche Boerse AG	2 867 966	0,06
23 380	EUR EssilorLuxottica SA	4 690 132	0,10	58 904	EUR Deutsche Lufthansa AG	523 670	0,01
4 174	EUR Eurazeo SE	331 287	0,01	81 981	EUR Deutsche Post AG	4 062 083	0,09
3 889	EUR Gecina SA REIT	472 988	0,01	259 870	EUR Deutsche Telekom AG	6 243 673	0,13
11 677	EUR Getlink SE	213 672	0,00	10 058	EUR Dr Ing hc F Porsche AG	887 735	0,02
2 555	EUR Hermes International SCA	5 415 585	0,12	181 372	EUR EON SE	2 434 284	0,05
3 355	EUR Ipsen SA	399 888	0,01	18 836	EUR Evonik Industries AG	384 933	0,01
6 377	EUR Kering SA	2 810 697	0,06	17 841	EUR Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	748 118	0,02
17 090	EUR Klepierre SA REIT	465 921	0,01	35 180	EUR Fresenius SE & Co KGaA	1 090 845	0,02
10 045	EUR La Francaise des Jeux SAEM	364 400	0,01	14 359	EUR GEA Group AG	597 826	0,01
17 661	EUR Legrand SA	1 835 818	0,04	3 607	EUR Hannover Rueck SE	861 842	0,02
18 758	EUR L'Oreal SA	9 337 931	0,20	11 611	EUR Heidelberg Materials AG	1 038 144	0,02
21 803	EUR LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	17 668 526	0,38	14 098	EUR Hellofresh SE	222 855	0,01
130 363	EUR Orange SA	1 483 833	0,03	8 418	EUR Henkel AG & Co KGaA	604 245	0,01
17 427	EUR Pernod Ricard SA	3 075 305	0,07				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				
Allemagne (suite)				Hong Kong (suite)				
14 176	EUR Henkel AG & Co KGaA–Preferred Stock	1 140 953	0,03	47 085	HKD Swire Pacific Ltd	398 578	0,01	
101 563	EUR Infineon Technologies AG	4 240 842	0,09	117 193	HKD Swire Properties Ltd	237 131	0,01	
7 111	EUR Knorr-Bremse AG	461 884	0,01	115 198	HKD Techtronic Industries Co Ltd	1 372 748	0,03	
7 187	EUR LEG Immobilien SE	629 731	0,01	721 000	HKD WH Group Ltd	465 367	0,01	
65 664	EUR Mercedes-Benz Group AG	4 537 111	0,10	196 186	HKD Xinyi Glass Holdings Ltd	220 091	0,00	
9 130	EUR Merck KGaA	1 453 314	0,03	Hong-Kong – Total			26 544 942	0,57
3 193	EUR MTU Aero Engines AG	688 676	0,02	Irlande				
10 197	EUR Muenchener Ruckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	4 225 170	0,09	48 136	USD Accenture PLC	16 891 404	0,36	
5 692	EUR Nemetschek SE	493 456	0,01	17 200	USD AerCap Holdings NV	1 278 304	0,03	
9 654	EUR Puma SE	538 760	0,01	94 562	EUR AIB Group PLC	405 297	0,01	
302	EUR Rational AG	233 356	0,01	7 196	USD Allegion PLC	911 661	0,02	
3 542	EUR Rheinmetall AG	1 122 937	0,02	88 271	EUR Bank of Ireland Group PLC	801 326	0,02	
44 019	EUR RWE AG	2 002 402	0,04	55 011	GBP CRH PLC	3 793 925	0,08	
81 211	EUR SAP SE	12 512 715	0,27	9 056	GBP DCC PLC	667 046	0,01	
2 038	EUR Sartorius AG–Preferred Stock	750 125	0,02	14 644	EUR Flutter Entertainment PLC	2 588 240	0,06	
7 578	EUR Scout24 SE	537 086	0,01	37 455	AUD James Hardie Industries PLC	1 443 738	0,03	
58 124	EUR Siemens AG	10 910 000	0,23	5 353	USD Jazz Pharmaceuticals PLC	658 419	0,01	
24 599	EUR Siemens Healthineers AG	1 429 315	0,03	52 744	USD Johnson Controls International PLC	3 040 164	0,06	
10 426	EUR Symrise AG	1 147 562	0,03	10 985	EUR Kerry Group PLC	954 506	0,02	
49 465	EUR Vonovia SE	1 559 469	0,03	12 270	EUR Kingspan Group PLC	1 062 638	0,02	
17 468	EUR Zalando SE	413 900	0,01	103 448	USD Medtronic PLC	8 522 046	0,18	
Allemagne – Total			2,22	14 948	USD Seagate Technology Holdings PLC	1 276 111	0,03	
Hong Kong				21 328	EUR Smurfit Kappa Group PLC	845 332	0,02	
861 401	HKD AIA Group Ltd	7 506 943	0,16	18 797	USD Trane Technologies PLC	4 584 588	0,10	
278 035	HKD BOC Hong Kong Holdings Ltd	754 857	0,02	8 865	USD Willis Towers Watson PLC	2 138 238	0,05	
164 684	HKD CK Asset Holdings Ltd	826 736	0,02	Irlande – Total			51 862 983	1,11
205 808	HKD CK Hutchison Holdings Ltd	1 103 030	0,02	Ile de Man				
58 436	HKD CK Infrastructure Holdings Ltd	323 291	0,01	47 082	GBP Entain PLC	596 720	0,01	
135 767	HKD CLP Holdings Ltd	1 120 590	0,02	Ile de Man – Total			596 720	0,01
145 800	HKD ESR Group Ltd	201 656	0,00	Israël				
5 300	USD Futu Holdings Ltd	289 539	0,01	3 064	ILS Azrieli Group Ltd	199 280	0,01	
177 018	HKD Galaxy Entertainment Group Ltd	991 802	0,02	110 654	ILS Bank Hapoalim BM	999 017	0,02	
188 108	HKD Hang Lung Properties Ltd	262 099	0,01	108 422	ILS Bank Leumi Le-Israel BM	876 493	0,02	
39 031	HKD Hang Seng Bank Ltd	455 113	0,01	5 925	USD Check Point Software Technologies Ltd	905 281	0,02	
147 694	HKD Henderson Land Development Co Ltd	454 891	0,01	3 719	USD CyberArk Software Ltd	814 647	0,02	
343 075	HKD HKT Trust & HKT Ltd	409 482	0,01	2 690	ILS Elbit Systems Ltd	573 723	0,01	
943 693	HKD Hong Kong & China Gas Co Ltd	722 706	0,02	74 529	ILS ICL Group Ltd	378 968	0,01	
98 900	HKD Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	3 394 382	0,07	1	ILS Israrcad Ltd	3	0,00	
112 260	USD Hongkong Land Holdings Ltd	390 665	0,01	116 551	ILS Israel Discount Bank Ltd	585 846	0,01	
12 976	USD Jardine Matheson Holdings Ltd	534 741	0,01	10 944	ILS Mizrahi Tefahot Bank Ltd	425 494	0,01	
219 337	HKD Link REIT	1 231 718	0,03	5 501	ILS Nice Ltd	1 113 827	0,02	
128 638	HKD MTR Corp Ltd	499 162	0,01	95 509	USD Teva Pharmaceutical Industries Ltd–ADR	997 114	0,02	
148 855	HKD New World Development Co Ltd	231 045	0,00	4 665	USD Wix.com Ltd	573 888	0,01	
110 437	HKD Power Assets Holdings Ltd	639 975	0,01	Israël – Total			8 443 581	0,18
329 113	HKD Sino Land Co Ltd	357 835	0,01	Italie				
94 000	HKD SITC International Holdings Co Ltd	162 273	0,00	8 425	EUR Amplifon SpA	291 671	0,01	
91 215	HKD Sun Hung Kai Properties Ltd	986 496	0,02	58 098	EUR Assicurazioni Generali SpA	1 226 120	0,03	
				99 957	EUR Banco BPM SpA	527 906	0,01	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
Italie (suite)				Japon (suite)			
701	EUR Davide Campari-Milano NV	7 910	0,00	212	JPY Daiwa House Investment Corp REIT	378 496	0,01
2 582	EUR DiaSorin SpA	265 940	0,01	99 743	JPY Daiwa Securities Group Inc	671 486	0,01
640 713	EUR Enel SpA	4 763 250	0,10	118 160	JPY Denso Corp	1 782 709	0,04
170 002	EUR Eni SpA	2 882 243	0,06	4 443	JPY Dentsu Group Inc	114 022	0,00
10 465	EUR Ferrari NV	3 528 162	0,07	7 200	JPY Disco Corp	1 786 466	0,04
55 478	EUR FinecoBank Banca Fineco SpA	832 540	0,02	25 732	JPY East Japan Railway Co	1 483 724	0,03
29 738	EUR Infrastrutture Wireless Italiane SpA	376 133	0,01	21 265	JPY Eisai Co Ltd	1 063 702	0,02
1 269 087	EUR Intesa Sanpaolo SpA	3 705 915	0,08	253 077	JPY ENEOS Holdings Inc	1 005 989	0,02
33 373	EUR Leonardo SpA	550 586	0,01	76 460	JPY FANUC Corp	2 249 111	0,05
51 952	EUR Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	643 041	0,01	13 545	JPY Fast Retailing Co Ltd	3 361 750	0,07
18 425	EUR Moncler SpA	1 133 672	0,02	12 206	JPY Fuji Electric Co Ltd	525 452	0,01
54 989	EUR Nexi SpA	449 867	0,01	31 882	JPY Fujifilm Holdings Corp	1 916 131	0,04
36 850	EUR Poste Italiane SpA	418 258	0,01	13 500	JPY Fujitsu Ltd	2 037 257	0,04
23 449	EUR Prysmian SpA	1 066 424	0,02	427	JPY GLP J-Reit REIT	425 546	0,01
7 314	EUR Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	394 518	0,01	12 746	JPY Hamamatsu Photonics KK	524 378	0,01
171 151	EUR Snam SpA	880 083	0,02	21 514	JPY Hankyu Hanshin Holdings Inc	685 036	0,01
806 432	EUR Telecom Italia SpA/Milano	262 081	0,01	1 857	JPY Hikari Tsushin Inc	307 963	0,01
81 799	EUR Terna - Rete Elettrica Nazionale	682 574	0,01	3 229	JPY Hirose Electric Co Ltd	365 662	0,01
132 185	EUR UniCredit SpA	3 586 937	0,08	7 987	JPY Hitachi Construction Machinery Co Ltd	211 147	0,00
Italie – Total		28 475 831	0,61	72 123	JPY Hitachi Ltd	5 202 801	0,11
Japon				323 809	JPY Honda Motor Co Ltd	3 367 173	0,07
64 000	JPY Advantest Corp	2 177 671	0,05	9 546	JPY Hoshizaki Corp	349 460	0,01
55 059	JPY Aeon Co Ltd	1 230 607	0,03	27 408	JPY Hoya Corp	3 426 486	0,07
14 785	JPY AGC Inc	549 115	0,01	30 913	JPY Hulic Co Ltd	323 755	0,01
531	JPY Aisin Corp	18 580	0,00	9 100	JPY Ividen Co Ltd	504 444	0,01
33 502	JPY Ajinomoto Co Inc	1 292 743	0,03	86 720	JPY Idemitsu Kosan Co Ltd	472 107	0,01
16 626	JPY ANA Holdings Inc	360 871	0,01	10 548	JPY Iida Group Holdings Co Ltd	157 981	0,00
40 941	JPY Asahi Group Holdings Ltd	1 526 938	0,03	82 985	JPY Inpex Corp	1 121 045	0,02
16 400	JPY Asahi Intecc Co Ltd	333 688	0,01	53 299	JPY Isuzu Motors Ltd	686 558	0,01
65 001	JPY Asahi Kasei Corp	479 047	0,01	91 157	JPY Itochu Corp	3 728 915	0,08
149 989	JPY Astellas Pharma Inc	1 793 740	0,04	10 906	JPY Japan Airlines Co Ltd	214 670	0,00
7 800	JPY Azbil Corp	258 156	0,01	43 817	JPY Japan Exchange Group Inc	927 125	0,02
28 859	JPY Bandai Namco Holdings Inc	578 592	0,01	627	JPY Japan Metropolitan Fund Invest REIT	453 194	0,01
11 700	JPY BayCurrent Consulting Inc	410 886	0,01	119 625	JPY Japan Post Bank Co Ltd	1 218 481	0,03
38 801	JPY Bridgestone Corp	1 607 305	0,03	145 094	JPY Japan Post Holdings Co Ltd	1 296 254	0,03
20 021	JPY Brother Industries Ltd	319 600	0,01	16 400	JPY Japan Post Insurance Co Ltd	291 287	0,01
82 545	JPY Canon Inc	2 119 541	0,05	119	JPY Japan Real Estate Investment Corp REIT	492 949	0,01
15 800	JPY Capcom Co Ltd	510 603	0,01	77 235	JPY Japan Tobacco Inc	1 996 890	0,04
59 185	JPY Central Japan Railway Co	1 504 604	0,03	52 413	JPY JFE Holdings Inc	813 260	0,02
52 579	JPY Chiba Bank Ltd	379 853	0,01	14 959	JPY JSR Corp	426 551	0,01
39 386	JPY Chubu Electric Power Co Inc	508 878	0,01	38 719	JPY Kajima Corp	647 193	0,01
56 302	JPY Chugai Pharmaceutical Co Ltd	2 133 390	0,05	62 903	JPY Kansai Electric Power Co Inc	835 256	0,02
102 645	JPY Concordia Financial Group Ltd	469 322	0,01	30 973	JPY Kao Corp	1 274 247	0,03
18 406	JPY Dai Nippon Printing Co Ltd	544 817	0,01	11 300	JPY Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	484 927	0,01
22 800	JPY Daifuku Co Ltd	461 321	0,01	121 766	JPY KDDI Corp	3 874 608	0,08
65 215	JPY Dai-ichi Life Holdings Inc	1 384 049	0,03	11 848	JPY Keisei Electric Railway Co Ltd	560 044	0,01
152 242	JPY Daiichi Sankyo Co Ltd	4 181 310	0,09	15 784	JPY Keyence Corp	6 954 902	0,15
19 025	JPY Daikin Industries Ltd	3 101 785	0,07	7 688	JPY Kikkoman Corp	470 834	0,01
2 050	JPY Daito Trust Construction Co Ltd	237 746	0,00	15 360	JPY Kintetsu Group Holdings Co Ltd	487 232	0,01
45 059	JPY Daiwa House Industry Co Ltd	1 365 385	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
49 240	JPY Kirin Holdings Co Ltd	721 591	0,02	76 029	JPY Nissan Motor Co Ltd	298 874	0,01
12 400	JPY Kobe Bussan Co Ltd	366 424	0,01	14 553	JPY Nissin Foods Holdings Co Ltd	507 982	0,01
8 200	JPY Koei Tecmo Holdings Co Ltd	93 557	0,00	6 953	JPY Nitori Holdings Co Ltd	931 144	0,02
19 874	JPY Koito Manufacturing Co Ltd	309 782	0,01	7 635	JPY Nitto Denko Corp	571 352	0,01
78 899	JPY Komatsu Ltd	2 063 977	0,04	267 564	JPY Nomura Holdings Inc	1 210 282	0,03
8 396	JPY Konami Group Corp	439 691	0,01	11 413	JPY Nomura Real Estate Holdings Inc	300 261	0,01
3 124	JPY Kose Corp	234 333	0,00	392	JPY Nomura Real Estate Master Fund Inc REIT	458 788	0,01
62 301	JPY Kubota Corp	937 962	0,02	31 250	JPY Nomura Research Institute Ltd	909 039	0,02
83 644	JPY Kyocera Corp	1 221 020	0,03	52 740	JPY NTT Data Group Corp	747 817	0,02
24 240	JPY Kyowa Kirin Co Ltd	407 496	0,01	62 742	JPY Obayashi Corp	542 951	0,01
5 800	JPY Lasertec Corp	1 529 196	0,03	6 237	JPY Obic Co Ltd	1 074 819	0,02
249 346	JPY LY Corp	883 800	0,02	22 949	JPY Odakyu Electric Railway Co Ltd	350 144	0,01
37 272	JPY M3 Inc	616 794	0,01	76 517	JPY Oji Holdings Corp	294 714	0,01
19 759	JPY Makita Corp	545 202	0,01	98 388	JPY Olympus Corp	1 424 037	0,03
122 703	JPY Marubeni Corp	1 939 592	0,04	17 051	JPY Omron Corp	796 189	0,02
30 300	JPY MatsukiyoCocokara & Co	536 665	0,01	29 661	JPY Ono Pharmaceutical Co Ltd	529 345	0,01
50 262	JPY Mazda Motor Corp	543 156	0,01	7 400	JPY Open House Group Co Ltd	219 564	0,00
7 806	JPY McDonald's Holdings Co Japan Ltd	338 308	0,01	3 600	JPY Oracle Corp Japan	277 571	0,01
21 306	JPY MEIJI Holdings Co Ltd	506 127	0,01	87 750	JPY Oriental Land Co Ltd	3 268 373	0,07
33 111	JPY MINEBEA MITSUMI Inc	680 751	0,01	82 517	JPY ORIX Corp	1 554 583	0,03
21 411	JPY MISUMI Group Inc Mitsubishi Chemical Group	362 900	0,01	31 701	JPY Osaka Gas Co Ltd	662 218	0,01
116 516	JPY Corp	714 072	0,01	11 216	JPY Otsuka Corp	462 467	0,01
243 180	JPY Mitsubishi Corp	3 887 120	0,08	32 990	JPY Otsuka Holdings Co Ltd	1 237 651	0,03
135 989	JPY Mitsubishi Electric Corp	1 928 231	0,04	30 784	JPY Pan Pacific International Holdings Corp	734 554	0,02
100 885	JPY Mitsubishi Estate Co Ltd	1 390 407	0,03	186 583	JPY Panasonic Holdings Corp	1 848 228	0,04
50 124	JPY Mitsubishi HC Capital Inc	336 625	0,01	93 345	JPY Rakuten Group Inc	415 808	0,01
26 180	JPY Mitsubishi Heavy Industries Ltd	1 530 355	0,03	111 688	JPY Recruit Holdings Co Ltd	4 724 043	0,10
888 029	JPY Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	7 631 204	0,16	122 300	JPY Renesas Electronics Corp	2 211 255	0,05
89 461	JPY Mitsui & Co Ltd	3 361 926	0,07	185 149	JPY Resona Holdings Inc	940 979	0,02
16 983	JPY Mitsui Chemicals Inc	503 780	0,01	48 765	JPY Ricoh Co Ltd	374 610	0,01
59 616	JPY Mitsui Fudosan Co Ltd	1 462 279	0,03	28 908	JPY Rohm Co Ltd	554 149	0,01
27 200	JPY Mitsui OSK Lines Ltd	871 488	0,02	20 647	JPY SBI Holdings Inc	464 550	0,01
195 552	JPY Mizuho Financial Group Inc	3 346 355	0,07	13 500	JPY SCSK Corp	267 740	0,01
23 800	JPY MonotaRO Co Ltd	259 896	0,01	18 038	JPY Secom Co Ltd	1 299 304	0,03
27 159	JPY MS&AD Insurance Group Holdings Inc	1 068 406	0,02	23 900	JPY Seiko Epson Corp	357 788	0,01
134 011	JPY Murata Manufacturing Co Ltd	2 845 048	0,06	33 434	JPY Sekisui Chemical Co Ltd	482 016	0,01
21 606	JPY NEC Corp	1 279 686	0,03	52 196	JPY Sekisui House Ltd	1 159 582	0,02
27 916	JPY Nexon Co Ltd	508 797	0,01	62 551	JPY Seven & i Holdings Co Ltd	2 482 429	0,05
29 404	JPY Nidec Corp	1 187 798	0,03	23 000	JPY SG Holdings Co Ltd	330 203	0,01
85 050	JPY Nintendo Co Ltd	4 439 516	0,09	23 025	JPY Shimadzu Corp	643 812	0,01
126	JPY Nippon Building Fund Inc REIT	546 077	0,01	2 972	JPY Shimano Inc	460 304	0,01
6 721	JPY Nippon Express Holdings Inc	382 055	0,01	45 248	JPY Shimizu Corp	300 605	0,01
62 350	JPY Nippon Paint Holdings Co Ltd	504 178	0,01	141 675	JPY Shin-Etsu Chemical Co Ltd	5 946 169	0,13
38	JPY Nippon Prologis Inc REIT	73 154	0,00	21 285	JPY Shionogi & Co Ltd	1 026 354	0,02
16 418	JPY Nippon Sanso Holdings Corp	439 739	0,01	34 034	JPY Shiseido Co Ltd	1 026 476	0,02
68 403	JPY Nippon Steel Corp	1 567 185	0,03	44 678	JPY Shizuoka Financial Group Inc	378 708	0,01
2 256 900	JPY Nippon Telegraph & Telephone Corp	2 758 291	0,06	4 610	JPY SMC Corp	2 477 327	0,05
41 109	JPY Nippon Yusen KK	1 274 560	0,03	233 300	JPY Softbank Corp	2 911 699	0,06
11 645	JPY Nissan Chemical Corp	454 798	0,01	69 840	JPY SoftBank Group Corp	3 117 486	0,07
				18 056	JPY Sampo Holdings Inc	883 205	0,02
				101 552	JPY Sony Group Corp	9 659 614	0,21

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
Japon (suite)				Jordanie			
8 300	JPY Square Enix Holdings Co Ltd	298 077	0,01	15 921	GBP Hikma Pharmaceuticals PLC	363 097	0,01
49 306	JPY Subaru Corp	904 421	0,02	Jordanie – Total			
27 400	JPY SUMCO Corp	410 961	0,01	Luxembourg			
134 766	JPY Sumitomo Chemical Co Ltd	328 837	0,01	39 795	EUR ArcelorMittal SA	1 128 662	0,02
89 209	JPY Sumitomo Corp	1 946 424	0,04	11 717	EUR Eurofins Scientific SE	763 389	0,02
59 066	JPY Sumitomo Electric Industries Ltd	752 256	0,02	41 585	EUR Tenaris SA	723 276	0,02
24 065	JPY Sumitomo Metal Mining Co Ltd	724 784	0,02	Luxembourg – Total			
102 354	JPY Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	4 995 003	0,11	Macao			
56 568	JPY Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	1 085 778	0,02	218 048	HKD Sands China Ltd	638 069	0,01
6 314	JPY Sumitomo Realty & Development Co Ltd	187 835	0,00	Macao – Total			
12 969	JPY Suntory Beverage & Food Ltd	427 762	0,01	Pays-Bas			
25 754	JPY Suzuki Motor Corp	1 102 099	0,02	39 712	EUR ABN AMRO Bank NV	596 164	0,01
9 530	JPY Sysmex Corp	531 187	0,01	1 755	EUR Adyen NV	2 261 642	0,05
17 107	JPY T&D Holdings Inc	271 870	0,01	86 239	EUR Aegon Ltd	499 945	0,01
16 031	JPY Taisei Corp	548 315	0,01	12 492	EUR Akzo Nobel NV	1 032 463	0,02
114 714	JPY Takeda Pharmaceutical Co Ltd	3 298 699	0,07	4 996	EUR Argenx SE	1 895 719	0,04
32 851	JPY TDK Corp	1 565 188	0,03	3 866	EUR ASM International NV	2 006 958	0,04
57 668	JPY Terumo Corp	1 890 633	0,04	31 353	EUR ASML Holding NV	23 610 063	0,51
18 400	JPY TIS Inc	405 510	0,01	13 070	EUR ASR Nederland NV	616 493	0,01
16 771	JPY Tobu Railway Co Ltd	450 740	0,01	6 311	EUR BE Semiconductor Industries NV	951 254	0,02
10 123	JPY Toho Co Ltd	342 436	0,01	7 688	EUR Euronext NV	667 939	0,01
140 594	JPY Tokio Marine Holdings Inc	3 519 338	0,08	7 831	EUR EXOR NV	782 872	0,02
34 748	JPY Tokyo Electron Ltd	6 224 718	0,13	44 185	EUR Ferrovial SE	1 611 672	0,04
21 787	JPY Tokyo Gas Co Ltd	500 399	0,01	7 663	EUR Heineken Holding NV	648 414	0,01
46 395	JPY Tokyo Corp	566 363	0,01	22 970	EUR Heineken NV	2 332 868	0,05
23 996	JPY TOPPAN Holdings Inc	669 771	0,01	3 589	EUR IMCD NV	624 621	0,01
126 732	JPY Toray Industries Inc	659 010	0,01	297 291	EUR ING Groep NV	4 441 973	0,10
22 400	JPY Tosoh Corp	286 157	0,01	11 045	EUR JDE Peet's NV	297 213	0,01
12 793	JPY TOTO Ltd	336 930	0,01	79 472	EUR Koninklijke Ahold Delhaize NV	2 283 825	0,05
11 626	JPY Toyota Industries Corp	948 354	0,02	268 027	EUR Koninklijke KPN NV	923 165	0,02
824 755	JPY Toyota Motor Corp	15 154 829	0,32	67 172	EUR Koninklijke Philips NV	1 564 540	0,03
14 555	JPY Toyota Tsusho Corp	857 731	0,02	14 877	EUR NN Group NV	587 511	0,01
11 073	JPY Trend Micro Inc	592 843	0,01	19 974	USD NXP Semiconductors NV	4 587 628	0,10
34 180	JPY Unicharm Corp	1 235 988	0,03	11 088	EUR OCI NV	321 397	0,01
13 850	JPY USS Co Ltd	278 611	0,01	101 403	EUR Prosus NV	3 022 720	0,07
19 974	JPY West Japan Railway Co	833 218	0,02	20 417	EUR Qiagen Nv	888 614	0,02
23 618	JPY Yakult Honsha Co Ltd	530 559	0,01	9 879	EUR Randstad NV	618 976	0,01
13 330	JPY Yamaha Corp	307 957	0,01	166 168	EUR Stellantis NV	3 882 241	0,08
72 486	JPY Yamaha Motor Co Ltd	647 582	0,01	19 218	EUR Wolters Kluwer NV	2 732 194	0,06
24 571	JPY Yamato Holdings Co Ltd	454 105	0,01	Pays-Bas – Total			
18 725	JPY Yaskawa Electric Corp	782 311	0,02	Nouvelle-Zélande			
22 174	JPY Yokogawa Electric Corp	422 939	0,01	59 474	NZD Auckland International Airport Ltd	331 372	0,01
10 250	JPY ZOZO Inc	230 839	0,00	51 201	NZD Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	765 063	0,02
Japon – Total				38 859	NZD Mercury NZ Ltd	162 384	0,00
				117 189	NZD Meridian Energy Ltd	411 058	0,01
Jersey				158 765	NZD Spark New Zealand Ltd	520 704	0,01
16 861	USD Ferguson PLC	3 255 353	0,07	12 390	AUD Xero Ltd	949 419	0,02
Jersey – Total				Nouvelle-Zélande – Total			
				3 140 000 0,07			

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
Norvège				Espagne (suite)			
34 259	NOK Adevinta ASA	379 167	0,01	491 702	EUR Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	4 468 023	0,10
16 613	NOK Aker BP ASA	483 388	0,01	1 296 744	EUR Banco Santander SA	5 413 939	0,12
73 481	NOK DNB Bank ASA	1 562 856	0,03	341 054	EUR CaixaBank SA	1 403 753	0,03
69 184	NOK Equinor ASA	2 194 593	0,05	48 161	EUR Cellnex Telecom SA	1 897 149	0,04
13 202	NOK Gjensidige Forsikring ASA	243 742	0,01	28 200	EUR EDP Renovaveis SA	577 075	0,01
8 574	NOK Kongsberg Gruppen ASA	392 916	0,01	18 203	EUR Enagas SA	306 948	0,01
38 224	NOK Mowi ASA	685 011	0,01	28 962	EUR Endesa SA	590 588	0,01
116 750	NOK Norsk Hydro ASA	786 327	0,02	27 911	EUR Grifols SA	476 507	0,01
57 217	NOK Orkla ASA	444 183	0,01	469 177	EUR Iberdrola SA	6 151 941	0,13
5 145	NOK Salmar ASA	288 364	0,01	90 625	EUR Industria de Diseno Textil SA	3 947 295	0,08
55 285	NOK Telenor ASA	634 740	0,01	12 245	EUR Naturgy Energy Group SA	365 214	0,01
16 064	NOK Yara International ASA	571 336	0,01	33 412	EUR Redeia Corp SA	550 307	0,01
Norvège – Total		8 666 623	0,19	94 479	EUR Repsol SA	1 403 726	0,03
Portugal				274 836	EUR Telefonica SA	1 072 914	0,02
252 447	EUR EDP - Energias de Portugal SA	1 270 233	0,03	Espagne – Total		32 730 319	0,70
44 997	EUR Galp Energia SGPS SA	663 077	0,01	Suède			
23 874	EUR Jeronimo Martins SGPS SA	607 621	0,01	15 731	SEK Alfa Laval AB	629 686	0,01
Portugal – Total		2 540 931	0,05	69 656	SEK Assa Abloy AB	2 006 493	0,04
Singapour				185 696	SEK Atlas Copco AB	3 197 859	0,07
330 203	SGD CapitaLand Ascendas REIT	758 483	0,02	106 057	SEK Atlas Copco AB	1 572 252	0,03
260 083	SGD CapitaLand Integrated Commercial Trust REIT	406 164	0,01	25 661	SEK Boliden AB	800 804	0,02
255 637	SGD Capitaland Investment Ltd/Singapore	612 397	0,01	62 259	SEK Epiroc AB	1 249 152	0,03
33 816	SGD City Developments Ltd	170 477	0,01	29 270	SEK Epiroc AB	512 334	0,01
152 301	SGD DBS Group Holdings Ltd	3 857 461	0,08	27 618	SEK EQT AB	781 033	0,02
555 387	SGD Genting Singapore Ltd	421 035	0,01	53 485	SEK Essity AB	1 326 796	0,03
144 900	SGD Keppel Corp Ltd	776 623	0,02	14 046	SEK Evolution AB	1 675 566	0,04
392 111	SGD Mapletree Logistics Trust REIT	517 226	0,01	44 136	SEK Fastighets AB Balder	313 222	0,01
248 000	SGD Mapletree Pan Asia Commercial Trust REIT	295 171	0,01	17 245	SEK Getinge AB	383 817	0,01
250 993	SGD Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	2 473 587	0,05	57 915	SEK H & M Hennes & Mauritz AB	1 014 993	0,02
26 400	USD Sea Ltd	1 069 200	0,02	172 490	SEK Hexagon AB	2 070 150	0,04
104 870	SGD Singapore Airlines Ltd	521 528	0,01	8 195	SEK Holmen AB	346 166	0,01
79 545	SGD Singapore Exchange Ltd	592 773	0,01	26 940	SEK Husqvarna AB	221 821	0,01
160 449	SGD Singapore Technologies Engineering Ltd	473 161	0,01	15 524	SEK Industrivarden AB	505 716	0,01
634 307	SGD Singapore Telecommunications Ltd	1 187 733	0,03	13 213	SEK Industrivarden AB	431 219	0,01
104 324	SGD United Overseas Bank Ltd	2 250 033	0,05	23 859	SEK Indutrade AB	619 803	0,01
34 898	SGD UOL Group Ltd	166 143	0,00	17 586	SEK Investment AB Latour	457 717	0,01
188 604	SGD Wilmar International Ltd	510 436	0,01	129 927	SEK Investor AB	3 010 360	0,06
Singapour – Total		17 059 631	0,37	9 693	SEK L E Lundbergforetagen AB	527 266	0,01
Afrique du Sud				16 059	SEK Lifco AB	393 912	0,01
44 441	GBP Mondi PLC	871 046	0,02	139 164	SEK Nibe Industrier AB	977 670	0,02
Afrique du Sud – Total		871 046	0,02	9 550	SEK Sagax AB	262 871	0,01
Espagne				82 922	SEK Sandvik AB	1 794 558	0,04
2 156	EUR Acciona SA	317 471	0,01	41 262	SEK Securitas AB	403 619	0,01
9 331	EUR ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	413 949	0,01	133 288	SEK Skandinaviska Enskilda Banken AB	1 835 746	0,04
3 547	EUR Aena SME SA	642 976	0,01	17 308	SEK Skanska AB	313 173	0,01
38 099	EUR Amadeus IT Group SA	2 730 544	0,06	28 782	SEK SKF AB	574 906	0,01
				56 922	SEK Svenska Cellulosa AB SCA	853 447	0,02
				125 241	SEK Svenska Handelsbanken AB	1 360 174	0,03
				72 194	SEK Swedbank AB	1 456 366	0,03
				18 217	SEK Swedish Orphan Biovitrum AB	482 637	0,01
				49 463	SEK Tele2 AB	424 746	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
Suède (suite)				Suisse (suite)			
249 909	SEK Telefonaktiebolaget LM Ericsson	1 564 992	0,03	1 700	CHF Swisscom AG	1 022 040	0,02
220 221	SEK Telia Co AB	562 252	0,01	24 126	USD TE Connectivity Ltd	3 389 703	0,07
107 844	SEK Volvo AB	2 800 476	0,06	6 112	CHF Temenos AG	568 028	0,01
21 278	SEK Volvo AB	563 734	0,01	255 789	CHF UBS Group AG	7 932 149	0,17
52 054	SEK Volvo Car AB	168 179	0,00	2 372	CHF VAT Group AG	1 187 902	0,03
Suède – Total			0,87	11 382	CHF Zurich Insurance Group AG	5 944 903	0,13
Suisse				Suisse – Total			
124 411	CHF ABB Ltd	5 513 611	0,12	142 267 256			
15 137	CHF Adecco Group AG	742 237	0,02	3,04			
41 925	CHF Alcon Inc	3 269 717	0,07	Royaume-Uni			
645	CHF Bachem Holding AG	49 813	0,00	80 225	GBP 3i Group PLC	2 475 976	0,05
4 441	CHF Baloise Holding AG	695 448	0,02	184 461	GBP abrdn PLC	420 097	0,01
2 145	CHF Banque Cantonale Vaudoise	276 519	0,01	13 755	GBP Admiral Group PLC	470 636	0,01
307	CHF Barry Callebaut AG	517 594	0,01	118 706	USD Amcor PLC	1 144 326	0,02
558	CHF BKW AG	99 116	0,00	99 233	GBP Anglo American PLC	2 492 852	0,05
39	CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	467 546	0,01	16 597	USD Aon PLC	4 830 059	0,10
7	CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	848 334	0,02	21 414	USD Aptiv PLC	1 921 264	0,04
31 964	USD Chubb Ltd	7 223 864	0,15	27 366	GBP Ashtead Group PLC	1 905 482	0,04
40 597	CHF Cie Financiere Richemont SA	5 583 203	0,12	30 604	GBP Associated British Foods PLC	923 461	0,02
21 678	CHF Clariant AG	319 896	0,01	120 539	GBP Astrazeneca PLC	16 288 286	0,35
16 833	GBP Coca-Cola HBC AG	494 623	0,01	86 500	GBP Auto Trader Group PLC	795 489	0,02
14 388	EUR DSM-Firmenich AG	1 462 221	0,03	234 258	GBP Aviva PLC	1 298 153	0,03
504	CHF EMS-Chemie Holding AG	407 799	0,01	251 111	GBP BAE Systems PLC	3 554 890	0,08
9 909	USD Garmin Ltd	1 273 703	0,03	1 262 169	GBP Barclays PLC	2 474 340	0,05
2 240	CHF Geberit AG	1 434 516	0,03	76 307	GBP Barratt Developments PLC	547 276	0,01
777	CHF Givaudan SA	3 216 382	0,07	8 250	GBP Berkeley Group Holdings PLC	493 041	0,01
43 670	CHF Holcim AG	3 425 525	0,07	1 294 525	GBP BP PLC	7 692 687	0,16
18 430	CHF Julius Baer Group Ltd	1 032 465	0,02	166 200	GBP British American Tobacco PLC	4 863 515	0,10
4 474	CHF Kuehne & Nagel International AG	1 540 504	0,03	590 958	GBP BT Group PLC	931 144	0,02
10 344	CHF Logitech International SA	980 262	0,02	28 977	GBP Bunzl PLC	1 178 382	0,03
5 743	CHF Lonza Group AG	2 413 472	0,05	26 269	GBP Burberry Group PLC	474 186	0,01
209 346	CHF Nestle SA	24 253 940	0,52	479 230	GBP Centrica PLC	859 262	0,02
159 411	CHF Novartis AG	16 074 629	0,34	50 812	USD CNH Industrial NV	618 890	0,01
1 942	CHF Partners Group Holding AG	2 798 843	0,06	12 597	USD Coca-Cola Europacific Partners PLC	840 724	0,02
53 835	CHF Roche Holding AG	15 639 111	0,34	141 668	GBP Compass Group PLC	3 875 640	0,08
2 394	CHF Roche Holding AG	743 530	0,02	10 568	GBP Croda International PLC	680 340	0,01
33 738	CHF Sandoz Group AG	1 084 715	0,02	177 952	GBP Diageo PLC	6 478 926	0,14
3 745	CHF Schindler Holding AG	935 749	0,02	61 079	GBP Experian PLC	2 493 189	0,05
1 816	CHF Schindler Holding AG	430 454	0,01	333 245	GBP GSK PLC	6 160 748	0,13
13 125	CHF SGS SA	1 131 215	0,02	455 146	GBP Haleon PLC	1 866 277	0,04
46 335	EUR Siemens Energy AG	614 208	0,01	13 655	GBP Halma PLC	397 585	0,01
27 155	CHF SIG Group AG	624 309	0,01	39 631	GBP Hargreaves Lansdown PLC	370 828	0,01
12 749	CHF Sika AG	4 145 905	0,09	1 515 422	GBP HSBC Holdings PLC	12 276 967	0,26
4 500	CHF Sonova Holding AG	1 467 118	0,03	51 027	GBP Imperial Brands PLC	1 175 114	0,03
48 550	EUR STMicroelectronics NV	2 426 524	0,05	84 043	GBP Informa PLC	836 962	0,02
9 803	CHF Straumann Holding AG	1 579 382	0,03	14 793	GBP InterContinental Hotels Group PLC	1 337 040	0,03
2 480	CHF Swatch Group AG	673 591	0,01	14 654	GBP Intertek Group PLC	793 192	0,02
4 315	CHF Swatch Group AG	225 837	0,01	163 607	GBP J Sainsbury PLC	631 121	0,01
1 655	CHF Swiss Life Holding AG	1 148 363	0,02	232 880	GBP JD Sports Fashion PLC	492 665	0,01
6 424	CHF Swiss Prime Site AG	685 791	0,02	189 909	GBP Kingfisher PLC	589 019	0,01
20 035	CHF Swiss Re AG	2 250 947	0,05	72 931	GBP Land Securities Group PLC REIT	655 270	0,01
				524 372	GBP Legal & General Group PLC	1 678 526	0,04
				38 282	USD Linde PLC	15 722 800	0,34

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				
Royaume-Uni (suite)				États-Unis (suite)				
5 282 014	GBP Lloyds Banking Group PLC	3 212 557	0,07	31 600	USD Airbnb Inc	4 302 024	0,09	
33 270	GBP London Stock Exchange Group PLC	3 933 343	0,08	13 139	USD Akamai Technologies Inc	1 555 001	0,03	
174 455	GBP M&G PLC	494 607	0,01	10 349	USD Albemarle Corp	1 495 224	0,03	
110 640	GBP Melrose Industries PLC	800 283	0,02	27 300	USD Albertsons Cos Inc	627 900	0,01	
285 575	GBP National Grid PLC	3 851 659	0,08	14 178	USD Alexandria Real Estate Equities Inc REIT	1 797 345	0,04	
420 142	GBP NatWest Group PLC	1 175 100	0,03	4 786	USD Align Technology Inc	1 311 364	0,03	
10 573	GBP Next PLC	1 094 181	0,02	15 780	USD Alliant Energy Corp	809 514	0,02	
38 579	GBP Ocado Group PLC	372 985	0,01	19 648	USD Allstate Corp	2 750 327	0,06	
43 526	GBP Pearson PLC	535 005	0,01	21 716	USD Ally Financial Inc	758 323	0,02	
9 592	USD Pentair PLC	697 434	0,01	8 486	USD Alnylam Pharmaceuticals Inc	1 624 305	0,03	
27 562	GBP Persimmon PLC	488 039	0,01	406 040	USD Alphabet Inc	57 223 217	1,22	
43 206	GBP Phoenix Group Holdings PLC	294 783	0,01	461 460	USD Alphabet Inc	64 461 347	1,38	
195 430	GBP Prudential PLC	2 210 318	0,05	130 756	USD Altria Group Inc	5 274 697	0,11	
56 376	GBP Reckitt Benckiser Group PLC	3 895 251	0,08	722 180	USD Amazon.com Inc	109 728 029	2,35	
151 210	GBP RELX PLC	5 994 912	0,13	22 709	USD Ameren Corp	1 642 769	0,04	
216 385	GBP Rentokil Initial PLC	1 215 936	0,03	39 634	USD American Electric Power Co Inc	3 219 073	0,07	
30 611	AUD Rio Tinto Ltd	2 833 586	0,06	48 275	USD American Express Co	9 043 838	0,19	
85 528	GBP Rio Tinto PLC	6 369 595	0,14	6 286	USD American Financial Group Inc	747 343	0,02	
592 719	GBP Rolls-Royce Holdings PLC	2 264 527	0,05	27 300	USD American Homes 4 Rent REIT	981 708	0,02	
87 945	GBP Sage Group PLC	1 314 516	0,03	59 241	USD American International Group Inc	4 013 578	0,09	
70 069	GBP Schroders PLC	384 004	0,01	35 015	USD American Tower Corp REIT	7 559 038	0,16	
70 705	GBP Segro PLC REIT	798 954	0,02	15 974	USD American Water Works Co Inc	2 108 408	0,05	
22 468	GBP Severn Trent PLC	738 682	0,02	8 599	USD Ameriprise Financial Inc	3 266 158	0,07	
514 631	GBP Shell PLC	16 870 362	0,36	15 416	USD AMETEK Inc	2 541 944	0,05	
31 806	GBP Smith & Nephew PLC	437 292	0,01	41 602	USD Amgen Inc	11 982 208	0,26	
33 931	GBP Smiths Group PLC	762 806	0,02	44 904	USD Amphenol Corp	4 451 334	0,10	
6 888	GBP Spirax-Sarco Engineering PLC	922 425	0,02	37 368	USD Analog Devices Inc	7 419 790	0,16	
84 937	GBP SSE PLC	2 009 633	0,04	40 680	USD Annaly Capital Management Inc	787 972	0,02	
46 643	GBP St James's Place PLC	406 472	0,01	5 940	USD ANSYS Inc	2 155 507	0,05	
168 078	GBP Standard Chartered PLC	1 428 296	0,03	27 400	USD APA Corp	983 112	0,02	
327 523	GBP Taylor Wimpey PLC	613 972	0,01	28 439	USD Apollo Global Management Inc	2 650 230	0,06	
600 882	GBP Tesco PLC	2 225 242	0,05	1 215 852	USD Apple Inc	234 087 986	5,01	
200 192	GBP Unilever PLC	9 697 778	0,21	64 610	USD Applied Materials Inc	10 471 343	0,22	
45 950	GBP United Utilities Group PLC	620 624	0,01	44 289	USD Archer-Daniels-Midland Co	3 198 552	0,07	
1 634 703	GBP Vodafone Group PLC	1 428 735	0,03	13 700	USD Ares Management Corp	1 629 204	0,03	
4 532	GBP Whitbread PLC	211 221	0,00	19 468	USD Arista Networks Inc	4 584 909	0,10	
54 994	GBP Wise PLC	612 729	0,01	17 708	USD Arthur J Gallagher & Co	3 982 175	0,09	
83 592	GBP Wpp PLC	802 420	0,02	2 600	USD Aspen Technology Inc	572 390	0,01	
Royaume-Uni – Total			202 026 891	4,32	4 663	USD Assurant Inc	785 669	0,02
États-Unis				555 954	USD AT&T Inc	9 328 908	0,20	
43 420	USD 3M Co	4 746 674	0,10	12 307	USD Atmos Energy Corp	1 426 381	0,03	
7 147	USD A O Smith Corp	589 199	0,01	16 942	USD Autodesk Inc	4 125 038	0,09	
135 386	USD Abbott Laboratories	14 901 937	0,32	32 065	USD Automatic Data Processing Inc	7 470 183	0,16	
135 798	USD AbbVie Inc	21 044 616	0,45	1 484	USD AutoZone Inc	3 837 045	0,08	
35 393	USD Adobe Inc	21 115 464	0,45	9 810	USD AvalonBay Communities Inc REIT	1 836 628	0,04	
124 001	USD Advanced Micro Devices Inc	18 278 987	0,39	45 945	USD Avantor Inc	1 048 924	0,02	
11 600	USD AECOM	1 072 188	0,02	6 773	USD Avery Dennison Corp	1 369 230	0,03	
59 201	USD AES Corp	1 139 619	0,02	6 000	USD Axon Enterprise Inc	1 549 980	0,03	
43 961	USD Aflac Inc	3 626 782	0,08	74 108	USD Baker Hughes Co	2 533 011	0,05	
19 808	USD Agilent Technologies Inc	2 753 906	0,06	27 030	USD Ball Corp	1 554 766	0,03	
15 849	USD Air Products and Chemicals Inc	4 339 456	0,09	556 834	USD Bank of America Corp	18 748 601	0,40	
				64 834	USD Bank of New York Mellon Corp	3 374 610	0,07	

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
43 352 USD	Baxter International Inc	1 675 988	0,04	113 955 USD	Charles Schwab Corp	7 840 104	0,17
22 586 USD	Becton Dickinson and Co	5 507 144	0,12	8 069 USD	Charter Communications Inc	3 136 259	0,07
14 800 USD	Bentley Systems Inc	772 264	0,02	17 509 USD	Cheniere Energy Inc	2 988 961	0,06
101 762 USD	Berkshire Hathaway Inc	36 294 435	0,78	9 100 USD	Chesapeake Energy Corp	700 154	0,02
12 302 USD	Best Buy Co Inc	963 001	0,02	141 878 USD	Chevron Corp	21 162 522	0,45
8 400 USD	Bill.com Holdings Inc	685 356	0,01	2 172 USD	Chipotle Mexican Grill Inc	4 967 277	0,11
11 939 USD	Biogen Inc	3 089 455	0,07	20 767 USD	Church & Dwight Co Inc	1 963 728	0,04
15 842 USD	BioMarin Pharmaceutical Inc	1 527 486	0,03	23 661 USD	Cigna Group	7 085 286	0,15
1 931 USD	Bio-Rad Laboratories Inc	623 501	0,01	13 413 USD	Cincinnati Financial Corp	1 387 709	0,03
9 400 USD	Bio-Techne Corp	725 304	0,02	7 045 USD	Cintas Corp	4 245 740	0,09
11 615 USD	BlackRock Inc	9 429 057	0,20	318 897 USD	Cisco Systems Inc	16 110 676	0,34
53 353 USD	Blackstone Inc	6 984 975	0,15	149 720 USD	Citigroup Inc	7 701 597	0,16
45 524 USD	Block Inc	3 521 281	0,08	42 231 USD	Citizens Financial Group Inc	1 399 535	0,03
2 870 USD	Booking Holdings Inc	10 180 521	0,22	27 500 USD	Cleveland-Cliffs Inc	561 550	0,01
10 720 USD	Booz Allen Hamilton Holding Corp	1 371 195	0,03	10 526 USD	Clorox Co	1 500 902	0,03
12 963 USD	BorgWarner Inc	464 724	0,01	21 100 USD	Cloudflare Inc	1 756 786	0,04
13 704 USD	Boston Properties Inc REIT	961 610	0,02	29 095 USD	CME Group Inc	6 127 407	0,13
117 441 USD	Boston Scientific Corp	6 789 264	0,15	22 508 USD	CMS Energy Corp	1 307 040	0,03
162 505 USD	Bristol-Myers Squibb Co	8 338 132	0,18	320 518 USD	Coca-Cola Co	18 888 126	0,40
34 495 USD	Broadcom Inc	38 505 044	0,82	38 318 USD	Cognizant Technology Solutions Corp	2 894 159	0,06
9 739 USD	Broadridge Financial Solutions Inc	2 003 799	0,04	12 000 USD	Coinbase Global Inc	2 087 040	0,04
11 196 CAD	Brookfield Renewable Corp	323 840	0,01	63 764 USD	Colgate-Palmolive Co	5 082 628	0,11
20 765 USD	Brown & Brown Inc	1 476 599	0,03	320 044 USD	Comcast Corp	14 033 929	0,30
20 233 USD	Brown-Forman Corp	1 155 304	0,02	29 425 USD	Conagra Brands Inc	843 320	0,02
10 600 USD	Builders FirstSource Inc	1 769 564	0,04	16 600 USD	Confluent Inc	388 440	0,01
12 786 USD	Bunge Global SA	1 290 747	0,03	92 553 USD	ConocoPhillips	10 742 627	0,23
3 586 USD	Burlington Stores Inc	697 405	0,02	26 441 USD	Consolidated Edison Inc	2 405 338	0,05
20 326 USD	Cadence Design Systems Inc	5 536 193	0,12	13 557 USD	Constellation Brands Inc	3 277 405	0,07
16 800 USD	Caesars Entertainment Inc	787 584	0,02	26 500 USD	Constellation Energy Corp	3 097 585	0,07
8 712 USD	Camden Property Trust REIT	865 014	0,02	4 323 USD	Cooper Cos Inc	1 635 996	0,04
17 790 USD	Campbell Soup Co	769 062	0,02	71 280 USD	Copart Inc	3 492 720	0,07
29 771 USD	Capital One Financial Corp	3 903 574	0,08	63 934 USD	Corning Inc	1 946 790	0,04
20 062 USD	Cardinal Health Inc	2 022 250	0,04	54 561 USD	Corteva Inc	2 614 563	0,06
4 200 USD	Carlisle Cos Inc	1 312 206	0,03	34 190 USD	CoStar Group Inc	2 987 864	0,06
15 062 USD	Carlyle Group Inc	612 873	0,01	34 406 USD	Costco Wholesale Corp	22 710 712	0,49
14 361 USD	CarMax Inc	1 102 063	0,02	64 000 USD	Coterra Energy Inc	1 633 280	0,04
81 327 USD	Carnival Corp	1 507 803	0,03	17 124 USD	CrowdStrike Holdings Inc	4 372 100	0,09
69 681 USD	Carrier Global Corp	4 003 173	0,09	35 870 USD	Crown Castle Inc REIT	4 131 865	0,09
14 545 USD	Catalent Inc	653 507	0,01	10 618 USD	Crown Holdings Inc	977 812	0,02
39 705 USD	Caterpillar Inc	11 739 577	0,25	149 405 USD	CSX Corp	5 179 871	0,11
8 633 USD	Choe Global Markets Inc	1 541 508	0,03	11 800 USD	Cummins Inc	2 826 926	0,06
22 412 USD	Cbre Group Inc	2 086 333	0,04	103 350 USD	CVS Health Corp	8 160 516	0,17
11 080 USD	CDW Corp	2 518 706	0,05	54 767 USD	Danaher Corp	12 669 798	0,27
8 447 USD	Celanese Corp	1 312 410	0,03	10 066 USD	Darden Restaurants Inc	1 653 844	0,04
12 400 USD	Celsius Holdings Inc	676 048	0,01	8 700 USD	Darling Ingredients Inc	433 608	0,01
13 707 USD	Cencora Inc	2 815 144	0,06	21 018 USD	Datadog Inc	2 551 165	0,05
44 679 USD	Centene Corp	3 315 629	0,07	4 833 USD	DaVita Inc	506 305	0,01
54 957 USD	CenterPoint Energy Inc	1 570 121	0,03	1 900 USD	Deckers Outdoor Corp	1 270 017	0,03
10 300 USD	Ceridian HCM Holding Inc	691 336	0,01	21 254 USD	Deere & Co	8 498 837	0,18
11 763 USD	CF Industries Holdings Inc	935 158	0,02	21 617 USD	Dell Technologies Inc	1 653 700	0,04
9 894 USD	CH Robinson Worldwide Inc	854 743	0,02	15 613 USD	Delta Air Lines Inc	628 111	0,01
1 100 USD	Charles River Laboratories International Inc	260 040	0,01	52 100 USD	Devon Energy Corp	2 360 130	0,05

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
31 780	USD Dexcom Inc	3 943 580	0,08	12 508	USD Expeditors International of Washington Inc	1 591 018	0,03
11 800	USD Diamondback Energy Inc	1 829 944	0,04	17 099	USD Extra Space Storage Inc REIT	2 741 483	0,06
2 600	USD Dick's Sporting Goods Inc	382 070	0,01	311 590	USD Exxon Mobil Corp	31 152 768	0,67
25 047	USD Digital Realty Trust Inc REIT	3 370 825	0,07	3 666	USD F5 Inc	656 141	0,01
18 721	USD Discover Financial Services	2 104 240	0,05	3 272	USD FactSet Research Systems Inc	1 560 908	0,03
12 047	USD DocuSign Inc	716 194	0,02	1 886	USD Fair Isaac Corp	2 195 323	0,05
17 486	USD Dollar General Corp	2 377 222	0,05	42 486	USD Fastenal Co	2 751 818	0,06
17 463	USD Dollar Tree Inc	2 480 619	0,05	17 745	USD FedEx Corp	4 488 953	0,10
69 720	USD Dominion Energy Inc	3 276 840	0,07	15 334	USD Fidelity National Financial Inc	782 341	0,02
2 998	USD Domino's Pizza Inc	1 235 866	0,03	42 280	USD Fidelity National Information Services Inc	2 539 760	0,05
18 400	USD DoorDash Inc	1 819 576	0,04	55 836	USD Fifth Third Bancorp	1 925 784	0,04
12 095	USD Dover Corp	1 860 332	0,04	900	USD First Citizens BancShares Inc/NC	1 277 073	0,03
50 429	USD Dow Inc	2 765 526	0,06	8 500	USD First Solar Inc	1 464 380	0,03
24 614	USD DR Horton Inc	3 740 836	0,08	46 188	USD FirstEnergy Corp	1 693 252	0,04
34 100	USD DraftKings Inc	1 202 025	0,03	45 622	USD Fiserv Inc	6 060 426	0,13
22 585	USD Dropbox Inc	665 806	0,01	4 523	USD FleetCor Technologies Inc	1 278 245	0,03
17 072	USD DTE Energy Co	1 882 359	0,04	11 953	USD FMC Corp	753 637	0,02
61 494	USD Duke Energy Corp	5 967 378	0,13	328 482	USD Ford Motor Co	4 004 196	0,09
38 661	USD Dupont De Nemours Inc	2 974 191	0,06	47 830	USD Fortinet Inc	2 799 490	0,06
19 693	USD Dynatrace Inc	1 077 010	0,02	26 450	USD Fortive Corp	1 947 513	0,04
5 188	USD Eastman Chemical Co	465 986	0,01	10 461	USD Fortune Brands Innovations Inc	796 501	0,02
31 618	USD Eaton Corp PLC	7 614 247	0,16	15 096	USD Fox Corp	447 898	0,01
41 536	USD eBay Inc	1 811 800	0,04	10 167	USD Fox Corp	281 118	0,01
21 119	USD Ecolab Inc	4 188 954	0,09	22 790	USD Franklin Resources Inc	678 914	0,01
25 328	USD Edison International	1 810 699	0,04	113 300	USD Freeport-McMoRan Inc	4 823 181	0,10
50 463	USD Edwards Lifesciences Corp	3 847 804	0,08	22 700	USD Gaming and Leisure Properties Inc REIT	1 120 245	0,02
21 275	USD Electronic Arts Inc	2 910 633	0,06	5 288	USD Gartner Inc	2 385 470	0,05
19 185	USD Elevance Health Inc	9 046 879	0,19	32 000	USD GE HealthCare Technologies Inc	2 474 240	0,05
62 744	USD Eli Lilly & Co	36 574 732	0,78	49 193	USD Gen Digital Inc	1 122 584	0,02
45 569	USD Emerson Electric Co	4 435 231	0,09	84 679	USD General Electric Co	10 807 581	0,23
11 400	USD Enphase Energy Inc	1 506 396	0,03	41 802	USD General Mills Inc	2 722 982	0,06
12 700	USD Entegris Inc	1 521 714	0,03	102 056	USD General Motors Co	3 665 852	0,08
17 751	USD Entergy Corp	1 796 224	0,04	11 880	USD Genuine Parts Co	1 645 380	0,04
45 996	USD EOG Resources Inc	5 563 216	0,12	99 985	USD Gilead Sciences Inc	8 099 785	0,17
5 017	USD Epam Systems Inc	1 491 755	0,03	19 640	USD Global Payments Inc	2 494 280	0,05
29 600	USD EQT Corp	1 144 336	0,02	8 257	USD Globe Life Inc	1 005 042	0,02
10 401	USD Equifax Inc	2 572 063	0,06	8 735	USD GoDaddy Inc	927 308	0,02
7 466	USD Equinix Inc REIT	6 013 042	0,13	25 330	USD Goldman Sachs Group Inc	9 771 554	0,21
22 519	USD Equitable Holdings Inc	749 883	0,02	14 800	USD Graco Inc	1 284 048	0,03
15 759	USD Equity LifeStyle Properties Inc REIT	1 111 640	0,02	75 681	USD Halliburton Co	2 735 868	0,06
28 802	USD Equity Residential REIT	1 761 530	0,04	20 929	USD Hartford Financial Services Group Inc	1 682 273	0,04
2 207	USD Erie Indemnity Co	739 168	0,02	10 324	USD Hasbro Inc	527 143	0,01
21 638	USD Essential Utilities Inc	808 179	0,02	15 451	USD HCA Healthcare Inc	4 182 277	0,09
4 993	USD Essex Property Trust Inc REIT	1 237 964	0,03	44 664	USD Healthpeak Properties Inc REIT	884 347	0,02
18 083	USD Estee Lauder Cos Inc	2 644 639	0,06	3 727	USD HEICO Corp	666 648	0,01
10 700	USD Etsy Inc	867 235	0,02	6 514	USD HEICO Corp	927 854	0,02
19 367	USD Evergy Inc	1 010 957	0,02	11 230	USD Henry Schein Inc	850 223	0,02
30 004	USD Eversource Energy	1 851 847	0,04	12 572	USD Hershey Co	2 343 924	0,05
14 256	USD Exact Sciences Corp	1 054 659	0,02	23 139	USD Hess Corp	3 335 718	0,07
76 220	USD Exelon Corp	2 736 298	0,06				
11 771	USD Expedia Group Inc	1 786 720	0,04				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
98 799	USD Hewlett Packard Enterprise Co	1 677 607	0,04	10 964	USD KLA Corp	6 373 373	0,14
14 400	USD HF Sinclair Corp	800 208	0,02	14 351	USD Knight-Swift Transportation Holdings Inc	827 335	0,02
18 218	USD Hilton Worldwide Holdings Inc	3 317 316	0,07	64 118	USD Kraft Heinz Co	2 371 084	0,05
21 279	USD Hologic Inc	1 520 385	0,03	55 914	USD Kroger Co	2 555 829	0,05
77 797	USD Home Depot Inc	26 960 550	0,58	16 000	USD L Brands Inc	690 560	0,01
51 641	USD Honeywell International Inc	10 829 634	0,23	14 312	USD L3Harris Technologies Inc	3 014 393	0,06
22 447	USD Hormel Foods Corp	720 773	0,02	6 002	USD Laboratory Corp of America Holdings	1 364 195	0,03
41 517	USD Host Hotels & Resorts Inc REIT	808 336	0,02	9 784	USD Lam Research Corp	7 663 416	0,16
22 549	USD Howmet Aerospace Inc	1 220 352	0,03	9 300	USD Lamb Weston Holdings Inc	1 005 237	0,02
74 400	USD HP Inc	2 238 696	0,05	31 300	USD Las Vegas Sands Corp	1 540 273	0,03
4 700	USD Hubbell Inc	1 545 971	0,03	6 300	USD Lattice Semiconductor Corp	434 637	0,01
3 300	USD HubSpot Inc	1 915 782	0,04	5 172	USD Lear Corp	730 338	0,02
10 050	USD Humana Inc	4 600 990	0,10	10 776	USD Leidos Holdings Inc	1 166 394	0,03
127 181	USD Huntington Bancshares Inc	1 617 742	0,03	17 303	USD Lennar Corp	2 578 839	0,06
3 595	USD Huntington Ingalls Industries Inc	933 406	0,02	2 266	USD Lennox International Inc	1 014 080	0,02
4 900	USD Hyatt Hotels Corp	639 009	0,01	10 527	USD Liberty Broadband Corp	848 371	0,02
4 790	USD IDEX Corp	1 039 957	0,02	17 385	USD Liberty Media Corp-Liberty Formula One	1 097 515	0,02
6 334	USD IDEXX Laboratories Inc	3 515 687	0,08	12 464	USD Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	358 714	0,01
24 651	USD Illinois Tool Works Inc	6 457 083	0,14	11 847	USD Live Nation Entertainment Inc	1 108 879	0,02
13 042	USD Illumina Inc	1 815 968	0,04	22 897	USD LKQ Corp	1 094 248	0,02
6 682	USD Incyte Corp	419 563	0,01	16 513	USD Loews Corp	1 149 140	0,02
28 387	USD Ingersoll Rand Inc	2 195 451	0,05	44 864	USD Lowe's Cos Inc	9 984 483	0,21
2 525	USD Insulet Corp	547 874	0,01	6 300	USD LPL Financial Holdings Inc	1 434 006	0,03
325 529	USD Intel Corp	16 357 832	0,35	31 000	USD Lucid Group Inc	130 510	0,00
46 747	USD Intercontinental Exchange Inc	6 003 717	0,13	21 981	USD LyondellBasell Industries NV	2 089 953	0,04
70 867	USD International Business Machines Corp	11 590 298	0,25	11 872	USD M&T Bank Corp	1 627 414	0,03
21 755	USD International Flavors & Fragrances Inc	1 761 502	0,04	5 100	USD Manhattan Associates Inc	1 098 132	0,02
19 388	USD International Paper Co	700 876	0,02	46 100	USD Marathon Oil Corp	1 113 776	0,02
25 191	USD Interpublic Group of Cos Inc	822 234	0,02	29 549	USD Marathon Petroleum Corp	4 383 890	0,09
21 885	USD Intuit Inc	13 678 782	0,29	1 079	USD Markel Group Inc	1 532 072	0,03
27 312	USD Intuitive Surgical Inc	9 213 976	0,20	3 296	USD MarketAxess Holdings Inc	965 234	0,02
49 424	USD Invitation Homes Inc REIT	1 685 853	0,04	18 583	USD Marriott International Inc	4 190 652	0,09
12 513	USD IQVIA Holdings Inc	2 895 258	0,06	38 449	USD Marsh & McLennan Cos Inc	7 284 932	0,16
24 841	USD Iron Mountain Inc REIT	1 738 373	0,04	5 195	USD Martin Marietta Materials Inc	2 591 837	0,06
6 449	USD J M Smucker Co	815 025	0,02	65 113	USD Marvell Technology Inc	3 926 965	0,08
10 700	USD Jabil Inc	1 363 180	0,03	19 921	USD Masco Corp	1 334 309	0,03
6 455	USD Jack Henry & Associates Inc	1 054 812	0,02	65 451	USD Mastercard Inc	27 915 506	0,60
10 440	USD Jacobs Solutions Inc	1 355 112	0,03	25 247	USD Match Group Inc	921 515	0,02
5 359	USD JB Hunt Transport Services Inc	1 070 407	0,02	21 906	USD McCormick & Co Inc	1 498 809	0,03
187 273	USD Johnson & Johnson	29 353 170	0,63	56 669	USD McDonald's Corp	16 802 925	0,36
226 016	USD JPMorgan Chase & Co	38 445 322	0,82	10 940	USD McKesson Corp	5 065 001	0,11
26 574	USD Juniper Networks Inc	783 402	0,02	198 166	USD Merck & Co Inc	21 604 057	0,46
20 597	USD Kellanova	1 151 578	0,02	172 824	USD Meta Platforms Inc	61 172 783	1,31
125 349	USD Kenvue Inc	2 698 764	0,06	51 091	USD MetLife Inc	3 378 648	0,07
86 407	USD Keurig Dr Pepper Inc	2 879 081	0,06	1 698	USD Mettler-Toledo International Inc	2 059 606	0,04
74 583	USD KeyCorp	1 073 995	0,02	18 040	USD MGM Resorts International	806 027	0,02
13 778	USD Keysight Technologies Inc	2 191 942	0,05	42 082	USD Microchip Technology Inc	3 794 955	0,08
27 396	USD Kimberly-Clark Corp	3 328 888	0,07	87 164	USD Micron Technology Inc	7 438 576	0,16
34 900	USD Kimco Realty Corp REIT	743 719	0,02	548 940	USD Microsoft Corp	206 423 398	4,42
151 590	USD Kinder Morgan Inc	2 674 048	0,06				
41 975	USD KKR & Co Inc	3 477 629	0,07				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
10 092	USD Mid-America Apartment Communities Inc REIT	1 356 970	0,03	119 568	USD Philip Morris International Inc	11 248 957	0,24
26 931	USD Moderna Inc	2 678 288	0,06	36 564	USD Phillips 66	4 868 131	0,10
4 877	USD Molina Healthcare Inc	1 762 109	0,04	48 595	USD Pinterest Inc	1 799 959	0,04
15 989	USD Molson Coors Beverage Co	978 687	0,02	17 184	USD Pioneer Natural Resources Co	3 864 338	0,08
102 547	USD Mondelez International Inc	7 427 479	0,16	29 506	USD PNC Financial Services Group Inc	4 569 004	0,10
5 808	USD MongoDB Inc	2 374 601	0,05	2 400	USD Pool Corp	956 904	0,02
3 800	USD Monolithic Power Systems Inc	2 396 964	0,05	15 474	USD PPG Industries Inc	2 314 137	0,05
63 854	USD Monster Beverage Corp	3 678 629	0,08	62 347	USD PPL Corp	1 689 604	0,04
12 840	USD Moody's Corp	5 014 790	0,11	14 582	USD Principal Financial Group Inc	1 147 166	0,02
96 634	USD Morgan Stanley	9 011 120	0,19	183 314	USD Procter & Gamble Co	26 862 834	0,57
28 636	USD Mosaic Co	1 023 164	0,02	46 963	USD Progressive Corp	7 480 267	0,16
12 993	USD Motorola Solutions Inc	4 067 978	0,09	71 414	USD Prologis Inc REIT	9 519 486	0,20
6 578	USD MSCI Inc	3 720 846	0,08	27 121	USD Prudential Financial Inc	2 812 719	0,06
28 994	USD Nasdaq Inc	1 685 711	0,04	10 157	USD PTC Inc	1 777 069	0,04
17 677	USD NetApp Inc	1 558 404	0,03	41 850	USD Public Service Enterprise Group Inc	2 559 127	0,05
34 483	USD Netflix Inc	16 789 083	0,36	12 140	USD Public Storage REIT	3 702 700	0,08
7 855	USD Neurocrine Biosciences Inc	1 034 975	0,02	12 553	USD PulteGroup Inc	1 295 721	0,03
84 035	USD Newmont Corp	3 478 209	0,07	8 276	USD Qorvo Inc	931 960	0,02
29 046	USD News Corp	713 079	0,02	86 020	USD Qualcomm Inc	12 441 073	0,27
158 868	USD NextEra Energy Inc	9 649 642	0,21	12 200	USD Quanta Services Inc	2 632 760	0,06
95 235	USD NIKE Inc	10 339 664	0,22	9 721	USD Quest Diagnostics Inc	1 340 331	0,03
15 665	USD NiSource Inc	415 906	0,01	16 884	USD Raymond James Financial Inc	1 882 566	0,04
4 197	USD Nordson Corp	1 108 680	0,02	55 358	USD Realty Income Corp REIT	3 178 656	0,07
17 757	USD Norfolk Southern Corp	4 197 400	0,09	12 008	USD Regency Centers Corp REIT	804 536	0,02
17 325	USD Northern Trust Corp	1 461 883	0,03	8 606	USD Regeneron Pharmaceuticals Inc	7 558 564	0,16
20 500	USD NRG Energy Inc	1 059 850	0,02	76 202	USD Regions Financial Corp	1 476 795	0,03
18 040	USD Nucor Corp	3 139 682	0,07	5 200	USD Reliance Steel & Aluminum Co	1 454 336	0,03
192 116	USD Nvidia Corp	95 139 686	2,04	4 700	USD Repligen Corp	845 060	0,02
257	USD NVR Inc	1 799 116	0,04	16 030	USD Republic Services Inc	2 643 507	0,06
51 258	USD Occidental Petroleum Corp	3 060 615	0,07	8 977	USD ResMed Inc	1 544 224	0,03
13 162	USD Okta Inc	1 191 556	0,03	4 110	USD Revvity Inc	449 264	0,01
7 890	USD Old Dominion Freight Line Inc	3 198 054	0,07	51 200	USD Rivian Automotive Inc	1 201 152	0,03
10 839	USD Omnicom Group Inc	937 682	0,02	9 611	USD Robert Half Inc	844 999	0,02
32 981	USD On Semiconductor Corp	2 754 903	0,06	31 100	USD Roblox Corp	1 421 892	0,03
45 265	USD ONEOK Inc	3 178 508	0,07	8 197	USD Rockwell Automation Inc	2 545 005	0,05
127 498	USD Oracle Corp	13 442 114	0,29	9 988	USD Roku Inc	915 500	0,02
4 957	USD O'Reilly Automotive Inc	4 709 547	0,10	16 785	USD Rollins Inc	733 001	0,02
31 334	USD Otis Worldwide Corp	2 803 453	0,06	7 865	USD Roper Technologies Inc	4 287 762	0,09
7 759	USD Owens Corning	1 150 117	0,02	28 174	USD Ross Stores Inc	3 899 000	0,08
43 014	USD Paccar Inc	4 200 317	0,09	18 351	USD Royal Caribbean Cruises Ltd	2 376 271	0,05
7 364	USD Packaging Corp of America	1 199 669	0,03	30 700	USD Royalty Pharma PLC	862 363	0,02
152 000	USD Palantir Technologies Inc	2 609 840	0,06	7 982	USD RPM International Inc	891 031	0,02
23 120	USD Palo Alto Networks Inc	6 817 626	0,15	116 824	USD RTX Corp	9 829 571	0,21
44 529	USD Paramount Global	658 584	0,01	25 185	USD S&P Global Inc	11 094 496	0,24
9 529	USD Parker-Hannifin Corp	4 390 010	0,09	75 646	USD Salesforce Inc	19 905 488	0,43
26 121	USD Paychex Inc	3 111 272	0,07	9 166	USD SBA Communications Corp REIT	2 325 323	0,05
4 459	USD Paycom Software Inc	921 764	0,02	110 479	USD Schlumberger NV	5 749 327	0,12
3 700	USD Paylocity Holding Corp	609 945	0,01	10 730	USD SEI Investments Co	681 891	0,01
81 123	USD PayPal Holdings Inc	4 981 763	0,11	51 960	USD Sempra	3 882 971	0,08
106 902	USD PepsiCo Inc	18 156 236	0,39	15 895	USD ServiceNow Inc	11 229 659	0,24
439 109	USD Pfizer Inc	12 641 948	0,27	17 769	USD Sherwin-Williams Co	5 542 151	0,12
167 100	USD PG&E Corp	3 012 813	0,06	22 716	USD Simon Property Group Inc REIT	3 240 210	0,07

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
51 261	USD Sirius XM Holdings Inc	280 398	0,01	47 377	USD Union Pacific Corp	11 636 739	0,25
13 996	USD Skyworks Solutions Inc	1 573 430	0,03	56 235	USD United Parcel Service Inc	8 841 829	0,19
86 521	USD Snap Inc	1 464 801	0,03	4 889	USD United Rentals Inc	2 803 450	0,06
3 531	USD Snap-on Inc	1 019 894	0,02	4 000	USD United Therapeutics Corp	879 560	0,02
20 600	USD Snowflake Inc	4 099 400	0,09	72 015	USD UnitedHealth Group Inc	37 913 737	0,81
80 731	USD Southern Co	5 660 858	0,12	22 300	USD Unity Software Inc	911 847	0,02
14 244	USD Southwest Airlines Co	411 367	0,01	1 594	USD Universal Health Services Inc	242 989	0,01
13 142	USD Splunk Inc	2 002 184	0,04	65 546	EUR Universal Music Group NV	1 868 783	0,04
18 500	USD SS&C Technologies Holdings Inc	1 130 535	0,02	112 801	USD US Bancorp	4 882 027	0,10
9 614	USD Stanley Black & Decker Inc	943 133	0,02	3 648	USD Vail Resorts Inc	778 739	0,02
89 088	USD Starbucks Corp	8 553 339	0,18	29 138	USD Valero Energy Corp	3 787 940	0,08
25 709	USD State Street Corp	1 991 419	0,04	12 235	USD Veeva Systems Inc	2 355 482	0,05
10 273	USD Steel Dynamics Inc	1 213 241	0,03	33 663	USD Ventas Inc REIT	1 677 764	0,04
8 428	USD Steris Plc	1 852 896	0,04	19 300	USD Veralto Corp	1 587 618	0,03
25 980	USD Stryker Corp	7 779 971	0,17	6 663	USD VeriSign Inc	1 372 311	0,03
10 188	USD Sun Communities Inc REIT	1 361 626	0,03	11 852	USD Verisk Analytics Inc	2 830 969	0,06
3 900	USD Super Micro Computer Inc	1 108 614	0,02	326 943	USD Verizon Communications Inc	12 325 751	0,26
30 221	USD Synchrony Financial	1 154 140	0,02	19 532	USD Vertex Pharmaceuticals Inc	7 947 375	0,17
12 215	USD Synopsys Inc	6 289 626	0,13	28 200	USD Vertiv Holdings Co	1 354 446	0,03
41 330	USD Sysco Corp	3 022 463	0,06	29 241	USD VF Corp	549 731	0,01
14 393	USD T Rowe Price Group Inc	1 549 982	0,03	67 768	USD Viatrix Inc	733 927	0,02
14 262	USD Take-Two Interactive Software Inc	2 295 469	0,05	77 468	USD VICI Properties Inc REIT	2 469 680	0,05
13 900	USD Targa Resources Corp	1 207 493	0,03	124 972	USD Visa Inc	32 536 460	0,70
37 006	USD Target Corp	5 270 395	0,11	21 021	USD Vistra Corp	809 729	0,02
4 024	USD Teledyne Technologies Inc	1 795 871	0,04	11 116	USD Vulcan Materials Co	2 523 443	0,05
2 640	USD Teleflex Inc	658 258	0,01	17 659	USD W R Berkley Corp	1 248 844	0,03
9 783	USD Teradyne Inc	1 061 651	0,02	62 916	USD Walgreens Boots Alliance Inc	1 642 737	0,04
222 165	USD Tesla Inc	55 203 559	1,18	115 100	USD Walmart Inc	18 145 515	0,39
69 675	USD Texas Instruments Inc	11 876 800	0,25	143 517	USD Walt Disney Co	12 958 150	0,28
500	USD Texas Pacific Land Corp	786 225	0,02	192 660	USD Warner Bros Discovery Inc	2 192 471	0,05
10 812	USD Textron Inc	869 501	0,02	32 513	USD Waste Management Inc	5 823 078	0,12
30 331	USD Thermo Fisher Scientific Inc	16 099 391	0,34	5 053	USD Waters Corp	1 663 599	0,04
88 988	USD TJX Cos Inc	8 347 964	0,18	2 900	USD Watsco Inc	1 242 563	0,03
39 019	USD T-Mobile US Inc	6 255 916	0,13	21 785	USD WEC Energy Group Inc	1 833 643	0,04
21 800	USD Toast Inc	398 068	0,01	284 057	USD Wells Fargo & Co	13 981 286	0,30
9 200	USD Toro Co	883 108	0,02	36 205	USD Welltower Inc REIT	3 264 605	0,07
9 279	USD Tractor Supply Co	1 995 263	0,04	6 114	USD West Pharmaceutical Services Inc	2 152 862	0,05
37 150	USD Trade Desk Inc	2 673 314	0,06	25 586	USD Western Digital Corp	1 339 939	0,03
9 072	USD Tradeweb Markets Inc	824 463	0,02	10 357	USD Westinghouse Air Brake Technologies Corp	1 314 303	0,03
4 525	USD TransDigm Group Inc	4 577 490	0,10	3 600	USD Westlake Corp	503 856	0,01
11 893	USD TransUnion	817 168	0,02	20 291	USD WestRock Co	842 482	0,02
16 518	USD Travelers Cos Inc	3 146 514	0,07	61 807	USD Weyerhaeuser Co REIT	2 149 029	0,05
19 746	USD Trimble Inc	1 050 487	0,02	92 022	USD Williams Cos Inc	3 205 126	0,07
97 310	USD Truist Financial Corp	3 592 685	0,08	16 273	USD Workday Inc	4 492 324	0,10
14 818	USD Twilio Inc	1 124 242	0,02	17 152	USD WP Carey Inc REIT	1 111 621	0,02
3 624	USD Tyler Technologies Inc	1 515 267	0,03	3 703	USD WW Grainger Inc	3 068 639	0,07
25 105	USD Tyson Foods Inc	1 349 394	0,03	6 989	USD Wynn Resorts Ltd	636 768	0,01
141 612	USD Uber Technologies Inc	8 719 051	0,19	41 200	USD Xcel Energy Inc	2 550 692	0,05
25 506	USD UDR Inc REIT	976 625	0,02	17 624	USD Xylem Inc	2 015 481	0,04
8 595	USD U-Haul Holding Co	605 432	0,01	22 750	USD Yum! Brands Inc	2 972 515	0,06
21 000	USD UiPath Inc	521 640	0,01	4 465	USD Zebra Technologies Corp	1 220 418	0,03
3 315	USD Ulta Beauty Inc	1 624 317	0,03	12 558	USD Zillow Group Inc	726 606	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Autres valeurs mobilières			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,08 % (suite)				Bons de souscription – 0,00 %			
États-Unis (suite)				Canada			
12 774 USD	Zimmer Biomet Holdings Inc	1 554 596	0,03	1 608 CAD	Constellation Software Inc*	0	0,00
37 130 USD	Zoetis Inc	7 328 348	0,16	Canada – Total			
19 181 USD	Zoom Video Communications Inc	1 379 306	0,03	Total des bons de souscription			
États-Unis – Total				Total des autres valeurs mobilières			
		3 142 325 309	67,25			0	0,00
Total des actions ordinaires et préférentielles		4 629 430 809	99,08	TOTAL DES INVESTISSEMENTS		4 629 430 809	99,08
Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé		4 629 430 809	99,08				

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	1 356 000	831 594	6 646	0,00
Bought AUD / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	4 299 000	2 636 814	20 664	0,00
Bought AUD / Sold EUR, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	242 000	147 450	2 248	0,00
Bought AUD / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	33 000	17 255	521	0,00
Bought AUD / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	64 000	33 620	812	0,00
Bought AUD / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	2 256 000	1 203 265	5 458	0,00
Bought AUD / Sold SEK, due 03/01/24	UBS AG	2 409 000	16 347 789	21 630	0,00
Bought AUD / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	590 000	396 797	5 790	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	1 072 000	734 166	2 000	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	7 346 000	4 992 395	56 300	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 03/01/24	UBS AG	1 172 000	798 443	6 836	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	403 000	272 967	4 099	0,00
Bought CAD / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	56 000	32 789	670	0,00
Bought CAD / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	107 000	62 485	1 493	0,00
Bought CAD / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	3 990 000	2 357 979	20 034	0,00
Bought CAD / Sold SEK, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	3 943 000	29 618 773	51 344	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	975 000	729 429	10 004	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	4 898 000	3 707 144	7 461	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	21 000	15 652	275	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	189 000	143 229	168	0,00
Bought CHF / Sold AUD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	29 319	51 000	35	0,00
Bought CHF / Sold AUD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	735 782	1 276 000	3 535	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	113 182	177 000	241	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	1 355 336	2 113 000	7 849	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	5 107	8 000	17	0,00
Bought CHF / Sold DKK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	23 119	182 000	499	0,00
Bought CHF / Sold DKK, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	409 738	3 202 000	12 341	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	586 000	619 915	11 463	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	371 152	392 000	7 959	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	Goldman Sachs International	4 018 933	4 215 000	118 964	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	4 044 000	4 349 042	678	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	UBS AG	644 000	682 332	11 425	0,00
	Westpac Banking Corporation	221 000	232 333	5 933	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	Corporation	221 000	232 333	5 933	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	14 058	15 000	164	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 02/02/24	Merrill Lynch International	914 276	985 000	210	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	30 000	27 340	791	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 03/01/24	BNP Paribas SA	32 922	30 000	872	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 03/01/24	Merrill Lynch International	1 805 202	1 636 000	59 264	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	5 389	5 000	47	0,00
Bought CHF / Sold HKD, due 03/01/24	Citibank NA	263 111	2 356 000	10 893	0,00
Bought CHF / Sold ILS, due 03/01/24	Merrill Lynch International	47 359	201 000	449	0,00
	Goldman Sachs International	21 987	41 000	164	0,00
Bought CHF / Sold NZD, due 03/01/24	International	21 987	41 000	164	0,00
Bought CHF / Sold SEK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	47 000	558 683	406	0,00
Bought CHF / Sold SEK, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	2 168 000	25 768 133	18 985	0,00
Bought CHF / Sold SEK, due 02/02/24	BNP Paribas SA	73 036	871 000	509	0,00
	Goldman Sachs International	171 875	263 000	4 833	0,00
Bought CHF / Sold SGD, due 03/01/24	International	171 875	263 000	4 833	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Bank of Montreal	386 326	446 000	13 011	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	11 027 599	12 646 767	455 591	0,01
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	1 828 407	2 110 000	62 409	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	13 201 998	15 276 668	409 184	0,01
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Merrill Lynch International	386 336	446 000	13 022	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	UBS AG	10 493 305	12 030 833	436 706	0,01
	Westpac Banking Corporation	385 487	445 000	13 013	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Corporation	385 487	445 000	13 013	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	217 446	258 222	913	0,00
Bought DKK / Sold CHF, due 03/01/24	UBS AG	832 000	103 724	51	0,00
Bought DKK / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	82 000	9 436	122	0,00
	Westpac Banking Corporation	307 000	35 661	32	0,00
Bought DKK / Sold GBP, due 03/01/24	Corporation	307 000	35 661	32	0,00
Bought DKK / Sold SEK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	6 006 000	8 909 208	5 956	0,00
Bought DKK / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	1 382 000	202 577	2 214	0,00
Bought EUR / Sold DKK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	149 318	1 113 000	15	0,00
Bought EUR / Sold DKK, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	1 858 738	13 846 000	1 493	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	BNP Paribas SA	326 843	282 000	1 554	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	111 000	95 203	1 252	0,00
	Goldman Sachs International	8 242 826	7 125 000	22 491	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	International	8 242 826	7 125 000	22 491	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	212 000	182 774	1 185	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	State Street Bank London	3 000	2 578	27	0,00
Bought EUR / Sold HKD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	1 208 445	10 316 000	13 791	0,00
	Westpac Banking Corporation	87 971	13 651 000	351	0,00
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	Corporation	87 971	13 651 000	351	0,00
Bought EUR / Sold SEK, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	7 610 000	84 117 363	59 631	0,00
Bought EUR / Sold SEK, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	1 491 938	16 486 000	12 181	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	626 883	688 000	4 486	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	60 814 285	66 503 969	674 541	0,01
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	49 202 119	53 766 403	584 725	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	49 206 573	53 766 399	589 649	0,01
	Westpac Banking Corporation	2 368 702	2 573 513	43 075	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	57 924	108 000	148	0,00
Bought GBP / Sold AUD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	2 022 104	2 156 000	8 843	0,00
Bought GBP / Sold CHF, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	624 544	5 347 000	2 765	0,00
	Westpac Banking Corporation	18 105	155 000	81	0,00
Bought GBP / Sold DKK, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	5 450 000	6 267 409	24 363	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	6 989 964	8 030 000	31 535	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 02/02/24	Citibank NA	29 156	288 000	286	0,00
Bought GBP / Sold HKD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	355 297	3 509 000	3 553	0,00
Bought GBP / Sold HKD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	130 410	1 686 000	134	0,00
Bought GBP / Sold NOK, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	2 883 000	36 643 607	39 194	0,00
Bought GBP / Sold SEK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	15 270	194 000	196	0,00
Bought GBP / Sold SEK, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	611 218	7 759 000	8 483	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	20 484 594	25 904 999	208 753	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	2 634 498	3 335 000	23 456	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	16 393 715	20 741 000	157 701	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	State Street Bank London	719 000	913 275	3 306	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	UBS AG	19 953 353	25 294 611	141 915	0,00
	Westpac Banking Corporation	1 920 812	2 426 421	22 228	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	556 000	59 372	662	0,00
Bought HKD / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	8 009 000	920 243	9 123	0,00
Bought HKD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	181 000	18 180	4	0,00
Bought HKD / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	3 509 000	350 588	2 450	0,00
	Westpac Banking Corporation	107 000	10 741	11	0,00
Bought HKD / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	4 110 000	5 223 276	8 054	0,00
Bought HKD / Sold SEK, due 03/01/24	UBS AG	4 965 000	635 362	479	0,00
Bought HKD / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	188 000	24 075	18	0,00
Bought HKD / Sold USD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	36 000	8 338	91	0,00
Bought ILS / Sold CHF, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	109 000	27 342	67	0,00
Bought ILS / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	879 000	218 926	2 269	0,00
Bought ILS / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	413 000	89 444	671	0,00
	Westpac Banking Corporation	9 000	1 926	44	0,00
Bought ILS / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	461 000	1 269 142	2 090	0,00
Bought ILS / Sold SEK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	89 000	24 288	428	0,00
Bought ILS / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	501 000	138 979	153	0,00
Bought ILS / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	501 000	138 979	153	0,00
Bought ILS / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	14 000	3 871	20	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 610 728 000	10 274 073	75 534	0,00
	Westpac Banking Corporation	103 196 000	662 483	149	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	15 598 000	99 182	1 437	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 02/02/24	Deutsche Bank AG	11 880 000	64 348	2 236	0,00
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	22 507 000	124 832	510	0,00
	Morgan Stanley And Co International	315 000	1 746	8	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	Standard Chartered Bank	875 932 000	4 858 192	19 911	0,00
Bought JPY / Sold SEK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	18 889 000	1 343 426	673	0,00
Bought JPY / Sold SEK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	845 720 000	59 606 008	84 075	0,00
Bought JPY / Sold SEK, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	1 341 000	94 586	126	0,00
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	200 225 000	1 416 562	3 675	0,00
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	4 594 000	32 519	67	0,00
Bought JPY / Sold USD, due 02/02/24	Deutsche Bank AG	32 650 000	230 879	1 733	0,00
Bought NOK / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	113 000	9 341	28	0,00
Bought NOK / Sold CHF, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	814 000	67 305	185	0,00
Bought NOK / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	542 000	46 183	2 353	0,00
Bought NOK / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	3 670 000	326 267	962	0,00
Bought NOK / Sold GBP, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	48 000	3 597	141	0,00
Bought NOK / Sold SEK, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	1 685 000	1 655 560	1 640	0,00
Bought NOK / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	443 000	42 317	1 304	0,00
Bought NZD / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	41 000	21 693	185	0,00
Bought NZD / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	211 000	120 055	977	0,00
Bought NZD / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	44 000	21 766	111	0,00
Bought NZD / Sold SEK, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	83 000	521 938	761	0,00
Bought SEK / Sold AUD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	930 422	134 000	889	0,00
Bought SEK / Sold AUD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	15 697 486	2 275 000	5 276	0,00
Bought SEK / Sold CAD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	3 319 247	430 000	3 252	0,00
Bought SEK / Sold CAD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	28 290 762	3 688 000	10 271	0,00
Bought SEK / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	3 213 172	267 176	1 390	0,00
Bought SEK / Sold DKK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	9 194 392	6 006 000	22 341	0,00
Bought SEK / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	5 326 209	475 200	3 576	0,00
Bought SEK / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	10 825 557	947 000	28 090	0,00
Bought SEK / Sold EUR, due 03/01/24	Goldman Sachs International	80 800 435	7 084 000	192 285	0,01
Bought SEK / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	125 000	9 519	269	0,00
Bought SEK / Sold GBP, due 03/01/24	BNP Paribas SA	2 194 542	166 254	5 818	0,00
Bought SEK / Sold GBP, due 03/01/24	Merrill Lynch International	37 739 982	2 860 000	98 918	0,00
Bought SEK / Sold GBP, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	242 000	18 604	296	0,00
Bought SEK / Sold HKD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	85 722	64 000	310	0,00
Bought SEK / Sold HKD, due 03/01/24	Citibank NA	5 406 488	4 046 000	18 322	0,00
Bought SEK / Sold ILS, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	1 301 483	461 000	1 119	0,00
Bought SEK / Sold NZD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	532 308	83 000	268	0,00
Bought SEK / Sold SGD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	3 368 332	431 000	7 493	0,00
Bought SEK / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	5 656 157	549 010	12 237	0,00
Bought SEK / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	285 712 400	27 416 469	934 062	0,02
Bought SEK / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	221 541 623	21 229 336	753 689	0,02
Bought SEK / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	221 544 224	21 229 332	753 950	0,02
Bought SEK / Sold USD, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	1 114 379	108 000	2 577	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought SGD / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	74 000	46 927	343	0,00
Bought SGD / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	915 000	623 995	4 358	0,00
Bought SGD / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	5 000	2 966	10	0,00
Bought SGD / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	397 000	235 414	858	0,00
	Westpac Banking				
Bought SGD / Sold GBP, due 03/01/24	Corporation	11 000	6 503	49	0,00
Bought SGD / Sold SEK, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	431 000	3 248 423	4 405	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	102 000	76 678	647	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	19 000	14 417	6	0,00
Bought USD / Sold AUD, due 02/02/24	Citibank NA	1 959 729	2 867 000	1 527	0,00
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	Citibank NA	2 849 834	2 377 702	24 786	0,00
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	UBS AG	2 849 833	2 378 414	23 939	0,00
Bought USD / Sold CHF, due 02/02/24	Citibank NA	3 255 935	2 708 000	28 745	0,00
Bought USD / Sold DKK, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	1 055 446	7 054 000	8 579	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	57 649 505	52 183 943	4 506	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	48 228 736	43 613 581	50 988	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	UBS AG	41 738 732	37 550 296	258 791	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	1 299 000	1 168 050	7 202	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 02/02/24	BNP Paribas SA	3 496 416	3 141 666	21 910	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 02/02/24	Deutsche Bank AG	3 491 430	3 141 668	16 922	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 02/02/24	UBS AG	3 496 225	3 141 666	21 719	0,00
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	BNP Paribas SA	24 057 666	18 810 741	77 741	0,00
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	23 453 668	18 340 272	73 496	0,00
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	UBS AG	28 887 734	22 631 012	37 728	0,00
Bought USD / Sold GBP, due 02/02/24	UBS AG	4 554 323	3 560 000	15 292	0,00
Bought USD / Sold JPY, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	7 559 628	1 059 303 000	12 714	0,00
Bought USD / Sold NOK, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	223 630	2 257 000	1 225	0,00
Bought USD / Sold NZD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	96 271	152 000	22	0,00
Bought USD / Sold SEK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	24 714 630	246 740 177	231 216	0,01
Bought USD / Sold SEK, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	21 776 332	216 326 017	310 839	0,01
Bought USD / Sold SEK, due 03/01/24	UBS AG	21 776 332	216 304 633	312 961	0,01
Bought USD / Sold SEK, due 02/02/24	BNP Paribas SA	1 072 422	10 634 000	15 976	0,00
Bought USD / Sold SGD, due 02/02/24	Royal Bank of Canada	408 472	537 000	824	0,00
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				9 255 027	0,20

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	1 312 000	758 284	(5 707)	(0,00)
Bought AUD / Sold CHF, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	15 000	8 688	(87)	(0,00)
Bought AUD / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	2 867 000	1 957 886	(1 589)	(0,00)
Bought AUD / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	114 000	78 192	(329)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	2 256 000	1 447 930	(9 414)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	24 000	15 540	(262)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought CAD / Sold CHF, due 03/01/24	Corporation	10 000	6 445	(74)	(0,00)
Bought CAD / Sold SEK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	87 000	664 975	(4)	(0,00)
Bought CAD / Sold SEK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	88 000	679 281	(665)	(0,00)
Bought CHF / Sold AUD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	134 331	236 000	(1 106)	(0,00)
Bought CHF / Sold CAD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	293 734	466 000	(3 513)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold DKK, due 02/02/24	UBS AG	103 556	832 000	(64)	(0,00)
Bought CHF / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	2 214 000	2 068 706	(6 639)	(0,00)
Bought CHF / Sold GBP, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	349 729	328 000	(1 423)	(0,00)
Bought CHF / Sold HKD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	59 229	556 000	(667)	(0,00)
Bought CHF / Sold ILS, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	8 317	36 000	(92)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	258 062	43 807 000	(4 118)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	2 658 966	447 504 000	(15 007)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	9 849	1 653 000	(39)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	643 155	108 276 000	(4 939)	(0,00)
Bought CHF / Sold NOK, due 03/01/24	Goldman Sachs International	75 690	927 000	(1 349)	(0,00)
Bought CHF / Sold NOK, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	9 319	113 000	(29)	(0,00)
Bought CHF / Sold NZD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	21 628	41 000	(187)	(0,00)
Bought CHF / Sold SEK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	458 183	5 490 506	(422)	(0,00)
Bought CHF / Sold SGD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	46 843	74 000	(351)	(0,00)
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	2 369 459	2 849 833	(26 091)	(0,00)
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	Citibank NA	2 370 285	2 849 834	(25 108)	(0,00)
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	UBS AG	2 371 007	2 849 833	(24 246)	(0,00)
Bought DKK / Sold CHF, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	2 552 000	325 684	(8 792)	(0,00)
Bought DKK / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	3 237 000	434 334	(113)	(0,00)
Bought DKK / Sold EUR, due 03/01/24	Merrill Lynch International	11 722 000	1 572 467	(8)	(0,00)
Bought DKK / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	5 347 000	623 723	(2 780)	(0,00)
Bought DKK / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	7 054 000	1 053 881	(8 589)	(0,00)
Bought DKK / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	274 000	40 891	(227)	(0,00)
Bought EUR / Sold AUD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	264 836	436 000	(4 954)	(0,00)
Bought EUR / Sold AUD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	3 301 761	5 461 000	(79 022)	(0,00)
Bought EUR / Sold AUD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	2 636 151	4 299 000	(20 843)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	530 805	786 000	(9 743)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	6 194 382	9 207 000	(139 894)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	4 988 659	7 346 000	(56 366)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	349 589	331 000	(7 101)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	3 553 000	3 379 894	(90 974)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	Merrill Lynch International	985 000	916 109	(388)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	Morgan Stanley And Co International	49 000	46 451	(1 063)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	5 416 853	5 164 000	(151 839)	(0,01)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	20 000	18 839	(290)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	4 357 394	4 044 000	(300)	(0,00)
Bought EUR / Sold DKK, due 02/02/24	Merrill Lynch International	1 572 946	11 722 000	(44)	(0,00)
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	8 030 000	6 982 791	(31 319)	(0,00)
Bought EUR / Sold GBP, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	6 260 921	5 450 000	(24 570)	(0,00)
Bought EUR / Sold HKD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	919 825	8 009 000	(9 094)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	244 450	988 000	(4 344)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	218 788	879 000	(2 278)	(0,00)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 194 703	192 014 000	(42 215)	(0,00)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	Goldman Sachs International	12 352 754	1 982 472 000	(416 087)	(0,01)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold JPY, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	10 309 186	1 610 728 000	(74 113)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 03/01/24	Goldman Sachs International	360 600	4 212 000	(16 406)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 02/02/24	HSBC Bank PLC Goldman Sachs International	326 124	3 670 000	(968)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 03/01/24	International	118 675	211 000	(2 500)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	119 926	211 000	(978)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	213 000	2 385 410	(1 408)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 03/01/24	BNP Paribas SA Goldman Sachs International	399 716	4 562 445	(11 174)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 03/01/24	International	1 708 667	19 488 000	(46 266)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	12 000	136 358	(275)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	713 009	1 040 000	(791)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	624 084	915 000	(4 394)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	3 141 668	3 487 283	(16 839)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	UBS AG	3 141 666	3 492 094	(21 652)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	183 500	204 066	(1 126)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	37 503 870	41 738 732	(261 557)	(0,01)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Deutsche Bank AG	37 557 463	41 738 736	(202 290)	(0,01)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	2 000	2 220	(8)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	State Street Bank London	25 500	28 355	(153)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	UBS AG Westpac Banking Corporation	37 505 926	41 738 732	(259 284)	(0,01)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Corporation	158 000	175 717	(978)	(0,00)
Bought GBP / Sold AUD, due 03/01/24	BNP Paribas SA Goldman Sachs International	117 925	225 000	(3 198)	(0,00)
Bought GBP / Sold AUD, due 03/01/24	International	1 055 713	2 020 000	(32 524)	(0,00)
Bought GBP / Sold AUD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	1 204 207	2 256 000	(5 505)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	102 720	173 000	(255)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	273 875	470 000	(7 309)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 03/01/24	Merrill Lynch International Westpac Banking Corporation	2 001 560	3 443 000	(59 557)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 03/01/24	Corporation	39 252	67 000	(773)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	2 358 647	3 990 000	(19 989)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	86 756	94 000	(1 089)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	212 323	233 000	(6 168)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	1 641 000	1 799 495	(46 109)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 03/01/24	Merrill Lynch International	1 737 464	1 917 000	(62 749)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 03/01/24	Royal Bank of Canada Westpac Banking Corporation	18 000	19 855	(644)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 03/01/24	Corporation	7 000	7 612	(120)	(0,00)
Bought GBP / Sold DKK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	75 126	649 000	(400)	(0,00)
Bought GBP / Sold DKK, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	45 118	389 000	(127)	(0,00)
Bought GBP / Sold DKK, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	545 125	4 698 000	(1 245)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	1 257 339	1 458 745	(8 548)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA Goldman Sachs International	881 776	1 022 000	(4 865)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	International	5 702 351	6 597 000	(18 022)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	UBS AG	882 023	1 027 603	(10 739)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	453 981	527 360	(3 814)	(0,00)
Bought GBP / Sold HKD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	12 495	125 000	(88)	(0,00)
Bought GBP / Sold HKD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	350 791	3 509 000	(2 423)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 03/01/24	Merrill Lynch International	90 110	422 000	(2 321)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	89 479	413 000	(672)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	315 429	56 933 000	(1 726)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	653 985	121 812 000	(30 331)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	3 864 804	717 635 000	(163 454)	(0,01)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	77 187	14 254 000	(2 708)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	4 879 703	875 932 000	(18 839)	(0,00)
Bought GBP / Sold NOK, due 03/01/24	Merrill Lynch International	128 305	1 734 000	(7 178)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	21 391	44 000	(590)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	21 766	44 000	(111)	(0,00)
Bought GBP / Sold SEK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	103 249	1 354 586	(2 790)	(0,00)
Bought GBP / Sold SEK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	156 010	2 066 914	(6 214)	(0,00)
Bought GBP / Sold SEK, due 03/01/24	Goldman Sachs International	498 913	6 583 000	(17 201)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	244 744	413 000	(1 093)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	235 691	397 000	(863)	(0,00)
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	457 764	585 000	(1 348)	(0,00)
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	18 334 650	23 453 666	(76 828)	(0,00)
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Citibank NA	1 405 853	1 796 000	(3 525)	(0,00)
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Deutsche Bank AG	18 337 375	23 453 668	(73 356)	(0,00)
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	UBS AG	18 471 145	23 630 143	(79 273)	(0,00)
Bought HKD / Sold CHF, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	1 800 000	199 365	(6 357)	(0,00)
Bought HKD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	2 307 000	272 119	(5 151)	(0,00)
Bought HKD / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	1 003 000	128 513	(64)	(0,00)
Bought ILS / Sold CHF, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	165 000	38 967	(477)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	484 074 000	2 941 644	(61 456)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	5 112 000	31 255	(875)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 125 000	12 782	(113)	(0,00)
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	220 306 000	1 426 668	(13 354)	(0,00)
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	253 907 000	1 639 616	(10 257)	(0,00)
Bought JPY / Sold SEK, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	18 858 000	1 366 399	(1 826)	(0,00)
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 059 303 000	7 525 170	(11 316)	(0,00)
Bought JPY / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	5 326 000	37 975	(30)	(0,00)
Bought NOK / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	1 686 000	130 331	(131)	(0,00)
Bought NOK / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	2 257 000	223 461	(1 222)	(0,00)
Bought NOK / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	72 000	7 155	(60)	(0,00)
Bought NZD / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	152 000	96 258	(19)	(0,00)
Bought SEK / Sold AUD, due 02/02/24	UBS AG	16 343 297	2 409 000	(21 739)	(0,00)
Bought SEK / Sold CAD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	29 595 650	3 943 000	(51 413)	(0,00)
Bought SEK / Sold CHF, due 03/01/24	Merrill Lynch International	24 745 037	2 069 000	(2 878)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought SEK / Sold CHF, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	4 040 000	342 698	(6 295)	(0,00)
Bought SEK / Sold CHF, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	25 817 320	2 168 000	(18 808)	(0,00)
Bought SEK / Sold DKK, due 02/02/24	BNP Paribas SA	8 911 657	6 006 000	(5 998)	(0,00)
Bought SEK / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	16 486 000	1 491 932	(12 198)	(0,00)
Bought SEK / Sold EUR, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	84 114 738	7 610 000	(59 763)	(0,00)
Bought SEK / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	7 759 000	610 590	(8 474)	(0,00)
Bought SEK / Sold GBP, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	36 605 007	2 883 000	(39 286)	(0,00)
Bought SEK / Sold HKD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	5 220 839	4 110 000	(8 034)	(0,00)
Bought SEK / Sold ILS, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	1 268 328	461 000	(2 093)	(0,00)
Bought SEK / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 702 106	108 294 000	(3 860)	(0,00)
Bought SEK / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	55 182 191	776 514 000	(32 165)	(0,00)
Bought SEK / Sold JPY, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	59 809 314	845 720 000	(83 439)	(0,00)
Bought SEK / Sold NOK, due 03/01/24	Merrill Lynch International	1 645 236	1 685 000	(2 664)	(0,00)
Bought SEK / Sold NOK, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	1 654 827	1 685 000	(1 641)	(0,00)
Bought SEK / Sold NZD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	521 375	83 000	(760)	(0,00)
Bought SEK / Sold SGD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	3 248 837	431 000	(4 422)	(0,00)
Bought SEK / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	216 688 015	21 846 592	(319 487)	(0,01)
Bought SEK / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	2 987 052	301 000	(4 248)	(0,00)
Bought SEK / Sold USD, due 02/02/24	Royal Bank of Canada	216 062 370	21 776 332	(311 383)	(0,01)
Bought SEK / Sold USD, due 02/02/24	UBS AG	216 042 272	21 776 332	(313 380)	(0,01)
Bought SGD / Sold CHF, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	189 000	123 293	(3 210)	(0,00)
Bought SGD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	125 000	86 550	(846)	(0,00)
Bought SGD / Sold USD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	537 000	407 931	(835)	(0,00)
Bought USD / Sold AUD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	71 682	108 000	(2 012)	(0,00)
Bought USD / Sold AUD, due 03/01/24	Citibank NA	2 213 557	3 349 000	(71 632)	(0,00)
Bought USD / Sold CAD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	4 079 776	5 547 000	(127 026)	(0,00)
Bought USD / Sold CAD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	256 074	347 000	(7 089)	(0,00)
Bought USD / Sold CAD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	3 708 719	4 898 000	(7 482)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	124 000	108 094	(4 430)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	13 088 700	11 228 808	(252 721)	(0,01)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	419 000	363 521	(12 915)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	State Street Bank London	10 090 000	8 722 987	(274 150)	(0,01)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	13 835 005	11 986 112	(406 202)	(0,01)
Bought USD / Sold DKK, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	1 237 946	8 436 000	(12 138)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	11 269 000	10 389 040	(207 255)	(0,01)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Citibank NA	3 856 009	3 528 668	(41 935)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	3 855 657	3 528 666	(42 285)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	96 000	87 859	(1 054)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	59 000	54 776	(1 508)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	State Street Bank London	4 510 000	4 128 717	(50 788)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	12 842 000	11 707 223	(90 384)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	310 000	246 091	(3 716)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	25 000	19 663	(66)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	State Street Bank London	914 000	719 351	(3 029)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	914 000	719 337	(3 011)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,06 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold HKD, due 03/01/24	UBS AG	764 067	5 968 000	(224)	(0,00)
Bought USD / Sold HKD, due 02/02/24	UBS AG	635 809	4 965 000	(464)	(0,00)
Bought USD / Sold ILS, due 03/01/24	Merrill Lynch International	159 358	590 000	(4 490)	(0,00)
Bought USD / Sold ILS, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	139 057	501 000	(154)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	678 377	99 775 000	(29 347)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	7 931 766	1 164 347 000	(327 185)	(0,01)
Bought USD / Sold NOK, due 03/01/24	Merrill Lynch International	252 709	2 700 000	(13 151)	(0,00)
Bought USD / Sold NZD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	93 462	152 000	(2 777)	(0,00)
Bought USD / Sold SEK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	1 911 758	19 988 855	(71 686)	(0,00)
Bought USD / Sold SEK, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	297 000	3 039 475	(4 600)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	478 716	639 000	(5 705)	(0,00)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(6 471 237)	(0,14)
Total des contrats de change à terme – couverture				2 783 790	0,06

Contrats à terme standardisés – 0,02 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
MSCI EAFE INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	72	8 108 640	177 942	0,00
S&P EMINI INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	124	29 884 000	721 275	0,02
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			37 992 640	899 217	0,02
Total des contrats à terme standardisés			37 992 640	899 217	0,02
Autres actifs/(passifs) nets				39 359 047	0,84
TOTAL DES ACTIFS NETS				4 672 472 863	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 747 478 USD détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

* Le Conseil d'administration a décidé de fixer le prix du titre à 0,00 conformément aux procédures d'évaluation des investissements en vigueur.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % <i>(suite)</i>			
Argentine				Australie <i>(suite)</i>			
1 302	USD MercadoLibre Inc	2 046 145	0,08	3 919	AUD Washington H Soul Pattinson & Co Ltd	87 631	0,00
Argentine – Total				Australie – Total			
2 046 145 0,08				51 366 308 2,13			
Australie				Autriche			
11 851	AUD Ampol Ltd	292 328	0,01	20 123	EUR Erste Group Bank AG	816 467	0,03
159 555	AUD ANZ Group Holdings Ltd	2 821 971	0,12	10 002	EUR OMV AG	439 407	0,02
76 028	AUD APA Group	443 036	0,02	3 367	EUR Verbund AG	312 612	0,01
28 659	AUD Aristocrat Leisure Ltd	798 254	0,03	3 401	EUR voestalpine AG	107 297	0,01
11 507	AUD ASX Ltd	495 134	0,02	Autriche – Total			
8 800	USD Atlassian Corp	2 093 168	0,09	1 675 783 0,07			
77 956	AUD Aurizon Holdings Ltd	202 134	0,01	Belgique			
29 808	AUD BlueScope Steel Ltd	475 944	0,02	20 123	EUR Erste Group Bank AG	816 467	0,03
80 292	AUD Brambles Ltd	745 106	0,03	49 929	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV	3 222 101	0,13
4 294	AUD Cochlear Ltd	875 106	0,04	749	EUR D'ieren Group	146 364	0,01
84 158	AUD Coles Group Ltd	925 120	0,04	1 621	EUR Elia Group SA/NV	202 879	0,01
94 959	AUD Commonwealth Bank of Australia	7 244 109	0,30	6 965	EUR Groupe Bruxelles Lambert NV	547 959	0,02
26 137	AUD Computershare Ltd	434 985	0,02	13 117	EUR KBC Group NV	850 835	0,04
27 115	AUD CSL Ltd	5 303 574	0,22	489	EUR Sofina SA	121 755	0,01
79 975	AUD Dexus REIT	419 105	0,02	3 994	EUR Syensqo SA	415 873	0,02
8 107	NZD EBOS Group Ltd	182 220	0,01	5 873	EUR Ucb SA	511 872	0,02
68 751	AUD Endeavour Group Ltd	244 413	0,01	11 115	EUR Umicore SA	305 727	0,01
95 086	AUD Fortescue Ltd	1 882 873	0,08	10 603	EUR Warehouses De Pauw CVA REIT	333 809	0,01
96 922	AUD Goodman Group REIT	1 673 208	0,07	Belgique – Total			
85 492	AUD GPT Group REIT	270 677	0,01	6 976 689 0,29			
6 272	AUD IDP Education Ltd	85 722	0,00	Bermudes			
32 707	AUD IGO Ltd	201 974	0,01	12 612	USD Arch Capital Group Ltd	936 693	0,04
115 229	AUD Insurance Australia Group Ltd	445 026	0,02	1 701	USD Everest Group Ltd	601 440	0,02
84 325	AUD Lottery Corp Ltd	278 490	0,01	11 500	USD Liberty Global Ltd	214 360	0,01
20 565	AUD Macquarie Group Ltd	2 576 792	0,11	Bermudes – Total			
46 890	AUD Medibank Pvt Ltd	113 904	0,00	1 752 493 0,07			
11 059	AUD Mineral Resources Ltd	528 227	0,02	Canada			
279 578	AUD Mirvac Group REIT	398 709	0,02	28 548	CAD Agnico Eagle Mines Ltd	1 572 890	0,07
84 667	AUD National Australia Bank Ltd	1 773 616	0,07	7 600	CAD Air Canada	107 723	0,00
72 618	AUD Northern Star Resources Ltd	676 370	0,03	58 600	CAD Algonquin Power & Utilities Corp	371 527	0,02
18 291	AUD Orica Ltd	198 945	0,01	44 028	CAD Alimentation Couche-Tard Inc	2 605 418	0,11
43 466	AUD Origin Energy Ltd	251 212	0,01	11 044	CAD AltaGas Ltd	233 008	0,01
175 550	AUD Pilbara Minerals Ltd	473 157	0,02	32 800	CAD ARC Resources Ltd	489 289	0,02
17 505	AUD Qantas Airways Ltd	64 142	0,00	39 483	CAD Bank of Montreal	3 925 843	0,16
87 986	AUD QBE Insurance Group Ltd	889 151	0,04	67 961	CAD Bank of Nova Scotia	3 324 347	0,14
10 508	AUD Ramsay Health Care Ltd	377 221	0,01	655	CAD BCE Inc	25 915	0,00
5 828	AUD REA Group Ltd	720 386	0,03	15 376	CAD Brookfield Asset Management Ltd	620 590	0,03
6 418	AUD Reece Ltd	98 053	0,00	81 103	CAD Brookfield Corp	3 269 092	0,14
174 978	AUD Santos Ltd	907 411	0,04	5 000	CAD BRP Inc	359 548	0,02
289 807	AUD Scentre Group REIT	591 272	0,02	14 330	CAD CAE Inc	310 813	0,01
12 192	AUD SEEK Ltd	222 372	0,01	28 112	CAD Cameco Corp	1 217 988	0,05
42 872	AUD Sonic Healthcare Ltd	938 459	0,04	300	CAD Canadian Apartment Properties REIT	11 103	0,00
178 935	AUD South32 Ltd	406 581	0,02	51 754	CAD Canadian Imperial Bank of Commerce	2 504 099	0,10
162 363	AUD Stockland REIT	493 008	0,02	34 023	CAD Canadian National Railway Co	4 297 384	0,18
60 573	AUD Suncorp Group Ltd	572 448	0,02				
197 651	AUD Telstra Group Ltd	534 074	0,02				
186 348	AUD Transurban Group	1 743 288	0,07				
35 691	AUD Treasury Wine Estates Ltd	262 533	0,01				
126 158	AUD Vicinity Ltd REIT	175 611	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				
Canada (suite)				Canada (suite)				
38 618 CAD	Canadian Natural Resources Ltd	2 542 415	0,11	68 990 CAD	Shopify Inc	5 397 397	0,22	
26 169 CAD	Canadian Pacific Kansas City Ltd	2 080 660	0,09	31 739 CAD	Sun Life Financial Inc	1 654 106	0,07	
3 305 CAD	Canadian Tire Corp Ltd	352 707	0,02	41 193 CAD	Suncor Energy Inc	1 326 136	0,06	
7 503 CAD	CCL Industries Inc	339 075	0,01	57 440 CAD	TC Energy Corp	2 254 736	0,09	
40 667 CAD	Cenovus Energy Inc	680 970	0,03	31 034 CAD	Teck Resources Ltd	1 318 227	0,06	
10 411 CAD	CGI Inc	1 120 765	0,05	3 190 CAD	Telus Corp	57 045	0,00	
650 CAD	Constellation Software Inc	1 619 464	0,07	27 468 CAD	Telus Corp	491 199	0,02	
3 900 CAD	Descartes Systems Group Inc	329 279	0,01	1 600 CAD	TFI International Inc	218 705	0,01	
10 011 CAD	Dollarama Inc	724 974	0,03	4 231 CAD	Thomson Reuters Corp	621 623	0,03	
15 100 CAD	Element Fleet Management Corp	246 895	0,01	9 000 CAD	Tmx Group Ltd	218 755	0,01	
12 100 CAD	Emera Inc	461 573	0,02	3 000 CAD	Toromont Industries Ltd	264 144	0,01	
7 105 CAD	Empire Co Ltd	188 860	0,01	105 059 CAD	Toronto-Dominion Bank	6 821 744	0,28	
121 250 CAD	Enbridge Inc	4 386 186	0,18	10 800 CAD	Tourmaline Oil Corp	488 072	0,02	
701 CAD	Fairfax Financial Holdings Ltd	649 916	0,03	6 737 USD	Waste Connections Inc	1 005 632	0,04	
34 058 CAD	First Quantum Minerals Ltd	280 244	0,01	3 599 CAD	West Fraser Timber Co Ltd	309 406	0,01	
800 CAD	Firstservice Corp	130 229	0,01	26 464 CAD	Wheaton Precious Metals Corp	1 311 961	0,05	
30 588 CAD	Fortis Inc	1 264 486	0,05	2 903 CAD	WSP Global Inc	408 921	0,02	
11 412 CAD	Franco-Nevada Corp	1 270 241	0,05	Canada – Total			97 934 152	4,07
4 472 CAD	George Weston Ltd	557 898	0,02	Îles Caïmans				
5 900 CAD	GFL Environmental Inc	204 527	0,01	83 400 USD	Grab Holdings Ltd	281 058	0,01	
6 512 CAD	Gildan Activewear Inc	216 408	0,01	43 000 HKD	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	145 379	0,01	
7 100 CAD	Great-West Lifeco Inc	236 164	0,01	Îles Caïmans – Total			426 437	0,02
17 706 CAD	Hydro One Ltd	533 087	0,02	Chili				
4 602 CAD	iA Financial Corp Inc	315 258	0,01	22 904 GBP	Antofagasta PLC	490 381	0,02	
2 000 CAD	IGM Financial Inc	53 102	0,00	Chili – Total			490 381	0,02
5 111 CAD	Imperial Oil Ltd	292 567	0,01	Danemark				
10 004 CAD	Intact Financial Corp	1 546 652	0,06	230 DKK	AP Moller - Maersk A/S	413 760	0,02	
11 100 CAD	Ivanhoe Mines Ltd	108 171	0,00	227 DKK	AP Moller - Maersk A/S	402 982	0,02	
11 040 CAD	Keyera Corp	268 172	0,01	5 522 DKK	Carlsberg AS	692 915	0,03	
45 211 CAD	Kinross Gold Corp	274 983	0,01	6 253 DKK	Chr Hansen Holding A/S	524 639	0,02	
6 070 CAD	Loblaw Cos Ltd	590 520	0,02	7 166 DKK	Coloplast A/S	819 778	0,03	
6 503 USD	Lululemon Athletica Inc	3 324 919	0,14	22 233 DKK	Danske Bank A/S	594 343	0,03	
27 620 CAD	Lundin Mining Corp	227 060	0,01	3 440 DKK	Demant A/S	150 887	0,01	
10 211 CAD	Magna International Inc	606 264	0,03	10 606 DKK	Dsv As	1 863 183	0,08	
112 765 CAD	Manulife Financial Corp	2 503 988	0,10	3 780 DKK	Genmab A/S	1 207 095	0,05	
15 100 CAD	MEG Energy Corp	271 058	0,01	186 601 DKK	Novo Nordisk A/S	19 303 409	0,80	
15 763 CAD	Metro Inc/CN REIT	819 948	0,03	10 720 DKK	Novozymes A/S	589 506	0,02	
19 620 CAD	National Bank of Canada	1 502 821	0,06	12 163 DKK	Orsted AS	674 626	0,03	
14 476 CAD	Northland Power Inc	264 248	0,01	5 089 DKK	Pandora A/S	703 736	0,03	
28 500 CAD	Nutrien Ltd	1 613 473	0,07	521 DKK	ROCKWOOLAS	152 555	0,01	
403 CAD	ONEX Corp	28 280	0,00	26 695 DKK	Tryg A/S	581 104	0,02	
15 607 CAD	Open Text Corp	659 149	0,03	56 544 DKK	Vestas Wind Systems A/S	1 795 606	0,07	
13 400 USD	Ovintiv Inc	588 528	0,02	Danemark – Total			30 470 124	1,27
7 300 CAD	Pan American Silver Corp	119 747	0,01	Finlande				
4 500 CAD	Parkland Corp	145 757	0,01	8 330 EUR	Elisa OYJ	385 277	0,02	
35 272 CAD	Pembina Pipeline Corp	1 220 316	0,05	8 640 EUR	Fortum Oyj	124 647	0,00	
18 687 CAD	Power Corp of Canada	536 971	0,02	17 049 EUR	Kesko Oyj	337 585	0,01	
13 200 CAD	RB Global Inc	887 641	0,04	18 415 EUR	Kone Oyj	918 651	0,04	
8 887 CAD	Restaurant Brands International Inc	697 764	0,03	32 057 EUR	Metso Oyj	324 726	0,01	
10 217 CAD	Rogers Communications Inc	480 631	0,02	29 351 EUR	Neste Oyj	1 044 331	0,04	
79 144 CAD	Royal Bank of Canada	8 042 845	0,33	279 538 EUR	Nokia Oyj	942 432	0,04	
5 500 CAD	Saputo Inc	111 910	0,01					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Finlande (suite)				France (suite)			
191 791	EUR Nordea Bank Abp	2 378 362	0,10	31 257	EUR Sanofi SA	3 099 238	0,13
2 932	EUR Orion Oyj	127 189	0,01	498	EUR Sartorius Stedim Biotech	131 753	0,01
26 760	EUR Sampo Oyj	1 170 889	0,05	31 288	EUR Schneider Electric SE	6 282 734	0,26
27 177	EUR Stora Enso OYJ	376 014	0,02	38 321	EUR Societe Generale SA	1 017 009	0,04
31 359	EUR UPM-Kymmene Oyj	1 179 863	0,05	1 946	EUR Sodexo SA	214 148	0,01
18 539	EUR Wartsila OYJ Abp	268 788	0,01	2 905	EUR Teleperformance SE	423 750	0,02
Finlande – Total		9 578 754	0,40	1 749	EUR Thales SA	258 796	0,01
France				132 453	EUR TotalEnergies SE	9 012 956	0,37
2 990	EUR Accor SA	114 280	0,00	5 049	EUR Unibail-Rodamco-Westfield REIT	373 238	0,02
2 027	EUR Aeroports de Paris SA	262 426	0,01	16 364	EUR Veolia Environnement SA	516 265	0,02
14 907	EUR Air Liquide SA	2 900 171	0,12	16 688	EUR Vinci SA	2 095 991	0,09
17 296	EUR Airbus SE	2 670 641	0,11	19 131	EUR Vivendi SE	204 483	0,01
16 191	EUR Alstom SA	217 844	0,01	11 579	EUR Worldline SA	200 431	0,01
2 391	EUR Amundi SA	162 699	0,01	France – Total		86 426 916	3,59
1 658	EUR Arkema SA	188 646	0,01	Allemagne			
107 749	EUR AXA SA	3 510 046	0,15	9 306	EUR adidas AG	1 893 142	0,08
1 425	EUR BioMerieux	158 357	0,01	17 741	EUR Allianz SE	4 741 639	0,20
61 668	EUR BNP Paribas SA	4 263 729	0,18	27 115	EUR BASF SE	1 461 087	0,06
41 532	EUR Bolloré SE	259 442	0,01	31 821	EUR Bayer AG	1 182 131	0,05
15 812	EUR Bouygues SA	595 965	0,03	18 668	EUR Bayerische Motoren Werke AG	2 078 246	0,09
17 923	EUR Bureau Veritas SA	452 795	0,02	2 967	EUR Bayerische Motoren Werke AG–Preferred Stock	294 811	0,01
4 035	EUR Capgemini SE	841 308	0,04	666	EUR Bechtle AG	33 393	0,00
32 641	EUR Carrefour SA	597 282	0,03	2 613	EUR Beiersdorf AG	391 691	0,02
12 824	EUR Cie de Saint-Gobain SA	944 308	0,04	4 641	EUR Brenntag SE	426 642	0,02
32 854	EUR Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	1 178 044	0,05	1 180	EUR Carl Zeiss Meditec AG	128 837	0,01
2 343	EUR Covivio SA REIT	125 993	0,01	60 613	EUR Commerzbank AG	720 448	0,03
67 952	EUR Credit Agricole SA	964 712	0,04	1 657	EUR Continental AG	140 795	0,01
34 551	EUR Danone SA	2 239 626	0,09	4 228	EUR Covestro AG	246 040	0,01
1 156	EUR Dassault Aviation SA	228 834	0,01	15 828	EUR Daimler Truck Holding AG	594 819	0,02
36 317	EUR Dassault Systemes SE	1 774 601	0,07	2 731	EUR Delivery Hero SE	75 450	0,00
13 580	EUR Edenred SE	812 162	0,03	53 131	EUR Deutsche Bank AG	725 658	0,03
5 462	EUR Eiffage SA	585 380	0,02	10 593	EUR Deutsche Boerse AG	2 182 341	0,09
98 295	EUR Engie SA	1 728 402	0,07	32 414	EUR Deutsche Lufthansa AG	288 168	0,01
7 664	EUR EssilorLuxottica SA	1 537 433	0,06	58 535	EUR Deutsche Post AG	2 900 356	0,12
1 962	EUR Eurazeo SE	155 722	0,01	98 605	EUR Deutsche Telekom AG	2 369 098	0,10
3 380	EUR Gecina SA REIT	411 082	0,02	2 803	EUR Dr Ing hc F Porsche AG	247 397	0,01
32 228	EUR Getlink SE	589 725	0,02	135 761	EUR EON SE	1 822 116	0,08
1 847	EUR Hermes International SCA	3 914 906	0,16	6 459	EUR Evonik Industries AG	131 996	0,01
783	EUR Ipsen SA	93 327	0,00	7 352	EUR Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	308 288	0,01
3 940	EUR Kering SA	1 736 576	0,07	11 782	EUR Fresenius SE & Co KGaA	365 331	0,02
9 381	EUR Klepierre SA REIT	255 752	0,01	8 544	EUR GEA Group AG	355 723	0,01
3 006	EUR La Francaise des Jeux SAEM	109 048	0,00	1 473	EUR Hannover Rueck SE	351 953	0,01
14 393	EUR Legrand SA	1 496 117	0,06	6 524	EUR Heidelberg Materials AG	583 313	0,02
10 754	EUR L'Oreal SA	5 353 455	0,22	12 331	EUR Hellofresh SE	194 923	0,01
16 123	EUR LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	13 065 617	0,54	9 509	EUR Henkel AG & Co KGaA	682 558	0,03
55 731	EUR Orange SA	634 348	0,03	5 548	EUR Henkel AG & Co KGaA–Preferred Stock	446 530	0,02
12 245	EUR Pernod Ricard SA	2 160 849	0,09	78 935	EUR Infineon Technologies AG	3 295 992	0,14
10 722	EUR Publicis Groupe SA	994 901	0,04	3 242	EUR Knorr-Bremse AG	210 579	0,01
858	EUR Remy Cointreau SA	108 996	0,00	3 330	EUR LEG Immobilien SE	291 777	0,01
5 236	EUR Renault SA	213 457	0,01	22 113	EUR Mercedes-Benz Group AG	1 527 917	0,06
11 281	EUR Safran SA	1 987 120	0,08				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Allemagne (suite)				Irlande			
7 543	EUR Merck KGaA	1 200 695	0,05	36 937	USD Accenture PLC	12 961 563	0,54
873	EUR MTU Aero Engines AG	188 291	0,01	10 200	USD AerCap Holdings NV	758 064	0,03
7 791	EUR Muenchener Ruckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	3 228 234	0,13	95 185	EUR AIB Group PLC	407 967	0,02
2 132	EUR Nemetschek SE	184 829	0,01	5 806	USD Allegion PLC	735 562	0,03
6 227	EUR Puma SE	347 510	0,01	38 908	EUR Bank of Ireland Group PLC	353 207	0,01
151	EUR Rational AG	116 678	0,00	41 532	GBP CRH PLC	2 864 323	0,12
2 734	EUR Rheinmetall AG	866 773	0,04	7 302	GBP DCC PLC	537 850	0,02
23 008	EUR RWE AG	1 046 622	0,04	10 049	EUR Flutter Entertainment PLC	1 776 101	0,07
61 282	EUR SAP SE	9 442 122	0,39	21 818	AUD James Hardie Industries PLC	840 995	0,04
983	EUR Sartorius AG–Preferred Stock	361 812	0,02	1 403	USD Jazz Pharmaceuticals PLC	172 569	0,01
3 481	EUR Scout24 SE	246 714	0,01	33 136	USD Johnson Controls International PLC	1 909 959	0,08
43 039	EUR Siemens AG	8 078 513	0,34	8 830	EUR Kerry Group PLC	767 255	0,03
9 745	EUR Siemens Healthineers AG	566 229	0,02	8 133	EUR Kingspan Group PLC	704 355	0,03
7 625	EUR Symrise AG	839 263	0,03	40 092	USD Medtronic PLC	3 302 779	0,14
23 780	EUR Vonovia SE	749 705	0,03	11 509	USD Seagate Technology Holdings PLC	982 523	0,04
10 082	EUR Zalando SE	238 890	0,01	13 574	EUR Smurfit Kappa Group PLC	538 003	0,02
Allemagne – Total		61 394 065	2,55	12 621	USD Trane Technologies PLC	3 078 262	0,13
Hong Kong				3 228	USD Willis Towers Watson PLC	778 594	0,03
673 912	HKD AIA Group Ltd	5 873 012	0,24	Irlande – Total			
232 000	HKD BOC Hong Kong Holdings Ltd	629 874	0,03	33 469 931			
134 300	HKD Budweiser Brewing Co APAC Ltd	251 451	0,01	1,39			
71 811	HKD CK Asset Holdings Ltd	360 501	0,02	Ile de Man			
61 172	HKD CK Hutchison Holdings Ltd	327 852	0,01	28 969 GBP Entain PLC			
1 500	HKD CK Infrastructure Holdings Ltd	8 299	0,00	367 155			
41 500	HKD CLP Holdings Ltd	342 532	0,01	Ile de Man – Total			
21 400	HKD ESR Group Ltd	29 598	0,00	367 155			
2 900	USD Futu Holdings Ltd	158 427	0,01	0,01			
83 000	HKD Galaxy Entertainment Group Ltd	465 035	0,02	Israël			
17 000	HKD Hang Lung Properties Ltd	23 687	0,00	2 136 ILS Azrieli Group Ltd			
38 300	HKD Hang Seng Bank Ltd	446 589	0,02	60 497 ILS Bank Hapoalim BM			
54 027	HKD Henderson Land Development Co Ltd	166 401	0,01	61 347 ILS Bank Leumi Le-Israel BM			
115 000	HKD HKT Trust & HKT Ltd	137 260	0,01	3 167 USD Check Point Software Technologies Ltd			
302 804	HKD Hong Kong & China Gas Co Ltd	231 896	0,01	2 000 USD CyberArk Software Ltd			
68 415	HKD Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	2 348 095	0,10	1 173 ILS Elbit Systems Ltd			
31 200	USD Hongkong Land Holdings Ltd	108 576	0,00	22 227 ILS ICL Group Ltd			
3 585	USD Jardine Matheson Holdings Ltd	147 738	0,01	1 ILS Isracard Ltd			
91 851	HKD Link REIT	515 802	0,02	29 719 ILS Israel Discount Bank Ltd			
86 498	HKD MTR Corp Ltd	335 644	0,01	6 194 ILS Mizrahi Tefahot Bank Ltd			
37 842	HKD New World Development Co Ltd	58 736	0,00	4 260 ILS Nice Ltd			
21 000	HKD Power Assets Holdings Ltd	121 693	0,01	40 600 USD Teva Pharmaceutical Industries Ltd–ADR			
176 238	HKD Sino Land Co Ltd	191 618	0,01	1 900 USD Wix.com Ltd			
10 000	HKD SITC International Holdings Co Ltd	17 263	0,00	Israël – Total			
32 133	HKD Sun Hung Kai Properties Ltd	347 521	0,01	4 376 586			
18 500	HKD Swire Pacific Ltd	156 604	0,01	0,18			
60 725	HKD Swire Properties Ltd	122 872	0,01	Italie			
28 000	HKD Techtronic Industries Co Ltd	333 660	0,01	4 426 EUR Amplifon SpA			
176 271	HKD WH Group Ltd	113 773	0,00	63 963 EUR Assicurazioni Generali SpA			
Hong-Kong – Total		14 372 009	0,60	37 166 EUR Banco BPM SpA			
				14 145 EUR Davide Campari-Milano NV			
				217 EUR DiaSorin SpA			
				482 235 EUR Enel SpA			
				65 017 EUR Eni SpA			
				2 550 EUR Ferrari NV			
				33 673 EUR FinecoBank Banca Fineco SpA			
				10 707 EUR Infrastrutture Wireless Italiane SpA			

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Italie (suite)				Japon (suite)			
660 842 EUR	Intesa Sanpaolo SpA	1 929 753	0,08	144 300 JPY	ENEOS Holdings Inc	573 597	0,02
9 640 EUR	Leonardo SpA	159 040	0,01	54 300 JPY	FANUC Corp	1 597 263	0,07
33 694 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	417 051	0,02	10 500 JPY	Fast Retailing Co Ltd	2 606 008	0,11
15 304 EUR	Moncler SpA	941 640	0,04	8 400 JPY	Fuji Electric Co Ltd	361 609	0,02
18 861 EUR	Nexi SpA	154 303	0,01	22 100 JPY	Fujifilm Holdings Corp	1 328 226	0,06
20 422 EUR	Poste Italiane SpA	231 795	0,01	11 500 JPY	Fujitsu Ltd	1 735 441	0,07
13 225 EUR	Prysmian SpA	601 452	0,02	104 JPY	GLP J-Reit REIT	103 646	0,00
909 EUR	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	49 032	0,00	2 700 JPY	Hamamatsu Photonics KK	111 080	0,00
117 033 EUR	Snam SpA	601 801	0,02	9 000 JPY	Hankyu Hanshin Holdings Inc	286 573	0,01
94 284 EUR	Telecom Italia SpA/Milano	30 641	0,00	800 JPY	Hikari Tsushin Inc	132 671	0,01
69 036 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale	576 073	0,02	320 JPY	Hirose Electric Co Ltd	36 238	0,00
90 801 EUR	UniCredit SpA	2 463 952	0,10	9 500 JPY	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	251 146	0,01
Italie – Total		16 225 741	0,67	52 200 JPY	Hitachi Ltd	3 765 598	0,16
Japon				255 300 JPY	Honda Motor Co Ltd	2 654 772	0,11
42 800 JPY	Advantest Corp	1 456 317	0,06	5 400 JPY	Hoshizaki Corp	197 683	0,01
35 800 JPY	Aeon Co Ltd	800 155	0,03	19 900 JPY	Hoya Corp	2 487 853	0,10
4 700 JPY	AGC Inc	174 558	0,01	34 500 JPY	Hulic Co Ltd	361 323	0,02
5 500 JPY	Aisin Corp	192 449	0,01	5 600 JPY	Ibiden Co Ltd	310 427	0,01
32 100 JPY	Ajinomoto Co Inc	1 238 644	0,05	34 085 JPY	Idemitsu Kosan Co Ltd	185 560	0,01
17 000 JPY	ANA Holdings Inc	368 989	0,02	24 100 JPY	Iida Group Holdings Co Ltd	360 953	0,02
28 300 JPY	Asahi Group Holdings Ltd	1 055 479	0,04	45 600 JPY	Inpex Corp	616 011	0,03
5 100 JPY	Asahi Intecc Co Ltd	103 769	0,00	27 800 JPY	Isuzu Motors Ltd	358 099	0,01
73 800 JPY	Asahi Kasei Corp	543 894	0,02	64 500 JPY	Itochu Corp	2 638 470	0,11
93 400 JPY	Astellas Pharma Inc	1 116 984	0,05	9 700 JPY	Japan Airlines Co Ltd	190 931	0,01
3 400 JPY	Azbil Corp	112 529	0,00	22 500 JPY	Japan Exchange Group Inc	476 078	0,02
16 250 JPY	Bandai Namco Holdings Inc	325 795	0,01	45 JPY	Japan Metropolitan Fund Invest REIT	32 526	0,00
3 000 JPY	BayCurrent Consulting Inc	105 355	0,00	56 200 JPY	Japan Post Bank Co Ltd	572 444	0,02
29 000 JPY	Bridgestone Corp	1 201 305	0,05	57 200 JPY	Japan Post Holdings Co Ltd	511 019	0,02
15 800 JPY	Brother Industries Ltd	252 219	0,01	4 900 JPY	Japan Post Insurance Co Ltd	87 031	0,00
27 800 JPY	Canon Inc	713 832	0,03	11 JPY	Japan Real Estate Investment Corp REIT	45 567	0,00
3 900 JPY	Capcom Co Ltd	126 035	0,01	41 600 JPY	Japan Tobacco Inc	1 075 557	0,04
19 500 JPY	Central Japan Railway Co	495 730	0,02	31 000 JPY	JFE Holdings Inc	481 008	0,02
20 900 JPY	Chiba Bank Ltd	150 991	0,01	10 500 JPY	JSR Corp	299 404	0,01
33 900 JPY	Chubu Electric Power Co Inc	437 997	0,02	11 900 JPY	Kajima Corp	198 910	0,01
36 600 JPY	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	1 386 844	0,06	13 900 JPY	Kansai Electric Power Co Inc	184 571	0,01
19 800 JPY	Concordia Financial Group Ltd	90 531	0,00	25 700 JPY	Kao Corp	1 057 313	0,04
19 500 JPY	Dai Nippon Printing Co Ltd	577 199	0,02	4 000 JPY	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	171 656	0,01
13 900 JPY	Daifuku Co Ltd	281 244	0,01	81 000 JPY	KDDI Corp	2 577 429	0,11
24 400 JPY	Dai-ichi Life Holdings Inc	517 838	0,02	3 500 JPY	Keisei Electric Railway Co Ltd	165 442	0,01
109 100 JPY	Daichi Sankyo Co Ltd	2 996 419	0,12	5 800 JPY	Keyence Corp	2 555 653	0,11
15 500 JPY	Daikin Industries Ltd	2 527 078	0,11	6 100 JPY	Kikkoman Corp	373 581	0,02
1 500 JPY	Daito Trust Construction Co Ltd	173 961	0,01	4 300 JPY	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	136 399	0,01
29 200 JPY	Daiwa House Industry Co Ltd	884 823	0,04	42 500 JPY	Kirin Holdings Co Ltd	622 819	0,03
42 JPY	Daiwa House Investment Corp REIT	74 985	0,00	3 000 JPY	Kobe Bussan Co Ltd	88 651	0,00
75 400 JPY	Daiwa Securities Group Inc	507 605	0,02	14 200 JPY	Koito Manufacturing Co Ltd	221 340	0,01
39 500 JPY	Denso Corp	595 946	0,02	52 200 JPY	Komatsu Ltd	1 365 538	0,06
4 400 JPY	Dentsu Group Inc	112 918	0,00	2 400 JPY	Konami Group Corp	125 686	0,01
2 800 JPY	Disco Corp	694 737	0,03	200 JPY	Kose Corp	15 002	0,00
6 800 JPY	East Japan Railway Co	392 092	0,02	73 700 JPY	Kubota Corp	1 109 578	0,05
14 800 JPY	Eisai Co Ltd	740 315	0,03	33 200 JPY	Kyocera Corp	484 647	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
11 700	JPY Kyowa Kirin Co Ltd	196 687	0,01	46 500	JPY Obayashi Corp	402 397	0,02
1 400	JPY Lasertec Corp	369 116	0,02	2 000	JPY Obic Co Ltd	344 659	0,01
140 100	JPY LY Corp	496 581	0,02	8 600	JPY Odakyu Electric Railway Co Ltd	131 214	0,01
5 700	JPY M3 Inc	94 326	0,00	4 300	JPY Oji Holdings Corp	16 562	0,00
5 400	JPY Makita Corp	149 000	0,01	52 200	JPY Olympus Corp	755 526	0,03
93 600	JPY Marubeni Corp	1 479 555	0,06	8 100	JPY Omron Corp	378 226	0,02
19 800	JPY MatsukiyoCocokara & Co	350 692	0,01	33 100	JPY Ono Pharmaceutical Co Ltd	590 719	0,02
25 800	JPY Mazda Motor Corp	278 808	0,01	1 600	JPY Open House Group Co Ltd	47 473	0,00
2 000	JPY McDonald's Holdings Co Japan Ltd	86 679	0,00	1 400	JPY Oracle Corp Japan	107 944	0,00
6 600	JPY MEIJI Holdings Co Ltd	156 784	0,01	62 000	JPY Oriental Land Co Ltd	2 309 278	0,10
8 700	JPY MINEBEA MITSUMI Inc	178 869	0,01	62 400	JPY ORIX Corp	1 175 588	0,05
9 000	JPY MISUMI Group Inc	152 543	0,01	7 600	JPY Osaka Gas Co Ltd	158 760	0,01
78 300	JPY Mitsubishi Chemical Group Corp	479 864	0,02	2 800	JPY Otsuka Corp	115 452	0,00
100 200	JPY Mitsubishi Corp	1 601 651	0,07	12 600	JPY Otsuka Holdings Co Ltd	472 701	0,02
61 700	JPY Mitsubishi Electric Corp	874 864	0,04	18 800	JPY Pan Pacific International Holdings Corp	448 597	0,02
58 300	JPY Mitsubishi Estate Co Ltd	803 496	0,03	144 500	JPY Panasonic Holdings Corp	1 431 368	0,06
16 600	JPY Mitsubishi Heavy Industries Ltd	970 355	0,04	119 300	JPY Rakuten Group Inc	531 426	0,02
336 500	JPY Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	2 891 685	0,12	82 100	JPY Recruit Holdings Co Ltd	3 472 566	0,14
36 800	JPY Mitsui & Co Ltd	1 382 937	0,06	84 400	JPY Renesas Electronics Corp	1 526 001	0,06
8 300	JPY Mitsui Chemicals Inc	246 209	0,01	49 800	JPY Resona Holdings Inc	253 098	0,01
58 900	JPY Mitsui Fudosan Co Ltd	1 444 717	0,06	19 800	JPY Ricoh Co Ltd	152 102	0,01
13 100	JPY Mitsui OSK Lines Ltd	419 724	0,02	6 000	JPY Rohm Co Ltd	115 016	0,00
136 530	JPY Mizuho Financial Group Inc	2 336 350	0,10	4 824	JPY SBI Holdings Inc	108 538	0,00
7 800	JPY MonotaRO Co Ltd	85 176	0,00	3 300	JPY SCSK Corp	65 448	0,00
26 100	JPY MS&AD Insurance Group Holdings Inc	1 026 746	0,04	12 800	JPY Secom Co Ltd	922 003	0,04
46 500	JPY Murata Manufacturing Co Ltd	987 193	0,04	10 700	JPY Seiko Epson Corp	160 181	0,01
14 200	JPY NEC Corp	841 041	0,03	14 500	JPY Sekisui Chemical Co Ltd	209 046	0,01
11 000	JPY Nexon Co Ltd	200 486	0,01	38 000	JPY Sekisui House Ltd	844 205	0,04
12 700	JPY Nidec Corp	513 027	0,02	24 900	JPY Seven & i Holdings Co Ltd	988 193	0,04
62 100	JPY Nintendo Co Ltd	3 241 551	0,13	15 900	JPY SG Holdings Co Ltd	228 271	0,01
23	JPY Nippon Building Fund Inc REIT	99 681	0,00	13 200	JPY Shimadzu Corp	369 091	0,02
7 300	JPY Nippon Express Holdings Inc	414 968	0,02	1 600	JPY Shimano Inc	247 808	0,01
28 000	JPY Nippon Paint Holdings Co Ltd	226 415	0,01	42 100	JPY Shimizu Corp	279 691	0,01
60	JPY Nippon Prologis Inc REIT	115 506	0,00	71 700	JPY Shin-Etsu Chemical Co Ltd	3 009 284	0,13
5 800	JPY Nippon Sanso Holdings Corp	155 347	0,01	12 200	JPY Shionogi & Co Ltd	588 279	0,02
17 400	JPY Nippon Steel Corp	398 652	0,02	22 800	JPY Shiseido Co Ltd	687 655	0,03
1 614 700	JPY Nippon Telegraph & Telephone Corp	1 973 420	0,08	18 200	JPY Shizuoka Financial Group Inc	154 270	0,01
32 500	JPY Nippon Yusen KK	1 007 643	0,04	2 000	JPY SMC Corp	1 074 762	0,04
6 400	JPY Nissan Chemical Corp	249 953	0,01	159 100	JPY Softbank Corp	1 985 647	0,08
64 700	JPY Nissan Motor Co Ltd	254 339	0,01	36 600	JPY SoftBank Group Corp	1 633 734	0,07
4 500	JPY Nissin Foods Holdings Co Ltd	157 075	0,01	19 800	JPY Sompo Holdings Inc	968 512	0,04
1 700	JPY Nitori Holdings Co Ltd	227 663	0,01	72 600	JPY Sony Group Corp	6 905 703	0,29
8 000	JPY Nitto Denko Corp	598 666	0,02	1 900	JPY Square Enix Holdings Co Ltd	68 235	0,00
187 500	JPY Nomura Holdings Inc	848 126	0,04	22 800	JPY Subaru Corp	418 221	0,02
7 600	JPY Nomura Real Estate Holdings Inc	199 946	0,01	7 100	JPY SUMCO Corp	106 490	0,00
162	JPY Nomura Real Estate Master Fund Inc REIT	189 601	0,01	55 900	JPY Sumitomo Chemical Co Ltd	136 399	0,01
31 400	JPY Nomura Research Institute Ltd	913 402	0,04	34 300	JPY Sumitomo Corp	748 381	0,03
14 900	JPY NTT Data Group Corp	211 272	0,01	31 900	JPY Sumitomo Electric Industries Ltd	406 274	0,02
				11 700	JPY Sumitomo Metal Mining Co Ltd	352 378	0,01
				72 700	JPY Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	3 547 851	0,15

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				
Japon (suite)				Pays-Bas				
49 600 JPY	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	952 033	0,04	16 580 EUR	ABN AMRO Bank NV	248 902	0,01	
6 600 JPY	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	196 343	0,01	648 EUR	Adyen NV	835 068	0,03	
4 800 JPY	Suntory Beverage & Food Ltd	158 320	0,01	69 845 EUR	Aegon Ltd	404 906	0,02	
10 300 JPY	Suzuki Motor Corp	440 771	0,02	9 472 EUR	Akzo Nobel NV	782 860	0,03	
7 800 JPY	Symex Corp	434 760	0,02	1 946 EUR	Argenx SE	738 405	0,03	
31 300 JPY	T&D Holdings Inc	497 430	0,02	2 647 EUR	ASM International NV	1 374 138	0,06	
4 500 JPY	Taisei Corp	153 915	0,01	23 492 EUR	ASML Holding NV	17 690 416	0,74	
43 737 JPY	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	1 257 695	0,05	6 788 EUR	ASR Nederland NV	320 180	0,01	
23 600 JPY	TDK Corp	1 124 423	0,05	4 350 EUR	BE Semiconductor Industries NV	655 673	0,03	
35 300 JPY	Terumo Corp	1 157 303	0,05	1 675 EUR	Euronext NV	145 525	0,01	
15 800 JPY	TIS Inc	348 210	0,01	2 534 EUR	EXOR NV	253 326	0,01	
8 400 JPY	Tobu Railway Co Ltd	225 760	0,01	16 073 EUR	Ferrovial SE	586 272	0,02	
4 300 JPY	Toho Co Ltd	145 458	0,01	2 411 EUR	Heineken Holding NV	204 010	0,01	
103 800 JPY	Tokio Marine Holdings Inc	2 598 313	0,11	15 779 EUR	Heineken NV	1 602 539	0,07	
27 400 JPY	Tokyo Electron Ltd	4 908 405	0,20	2 432 EUR	IMCD NV	423 260	0,02	
17 700 JPY	Tokyo Gas Co Ltd	406 530	0,02	213 869 EUR	ING Groep NV	3 195 523	0,13	
28 900 JPY	Tokyu Corp	352 794	0,01	6 566 EUR	JDE Peet's NV	176 686	0,01	
10 500 JPY	TOPPAN Holdings Inc	293 073	0,01	53 951 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV	1 550 415	0,06	
61 800 JPY	Toray Industries Inc	321 362	0,01	164 199 EUR	Koninklijke KPN NV	565 551	0,02	
3 300 JPY	Tosoh Corp	42 157	0,00	11 306 EUR	NN Group NV	446 488	0,02	
5 900 JPY	TOTO Ltd	155 389	0,01	14 900 USD	NXP Semiconductors NV	3 422 232	0,14	
4 100 JPY	Toyota Industries Corp	334 445	0,01	1 929 EUR	OCI NV	55 914	0,00	
306 700 JPY	Toyota Motor Corp	5 635 596	0,23	82 887 EUR	Prosus NV	2 470 777	0,10	
4 500 JPY	Toyota Tsusho Corp	265 187	0,01	8 450 EUR	Qiagen Nv	367 771	0,02	
3 600 JPY	Trend Micro Inc	192 742	0,01	7 787 EUR	Randstad NV	487 900	0,02	
23 100 JPY	Unicharm Corp	835 323	0,03	64 908 EUR	Stellantis NV	1 516 468	0,06	
11 400 JPY	USS Co Ltd	229 326	0,01	13 189 EUR	Wolters Kluwer NV	1 875 060	0,08	
15 300 JPY	West Japan Railway Co	638 242	0,03	Pays-Bas – Total			42 396 265	1,76
4 600 JPY	Yakult Honsha Co Ltd	103 335	0,00	Nouvelle-Zélande				
4 200 JPY	Yamaha Corp	97 031	0,00	70 559 NZD	Auckland International Airport Ltd	393 135	0,01	
57 900 JPY	Yamaha Motor Co Ltd	517 272	0,02	30 199 NZD	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	451 244	0,02	
13 000 JPY	Yamato Holdings Co Ltd	240 257	0,01	12 592 NZD	Mercury NZ Ltd	52 619	0,00	
15 900 JPY	Yaskawa Electric Corp	664 286	0,03	44 589 NZD	Meridian Energy Ltd	156 403	0,01	
28 100 JPY	Yokogawa Electric Corp	535 969	0,02	56 432 NZD	Spark New Zealand Ltd	185 081	0,01	
4 100 JPY	ZOZO Inc	92 336	0,00	8 782 AUD	Xero Ltd	672 946	0,03	
Japon – Total				Nouvelle-Zélande – Total				
163 094 989				1 911 428				
6,78				0,08				
Jersey				Norvège				
10 394 USD	Ferguson PLC	2 006 770	0,08	2 370 NOK	Adevinta ASA	26 230	0,00	
Jersey – Total				8 514 NOK	Aker BP ASA	247 732	0,01	
2 006 770				56 643 NOK	DNB Bank ASA	1 204 731	0,05	
Jordanie				54 494 NOK	Equinor ASA	1 728 610	0,07	
5 656 GBP	Hikma Pharmaceuticals PLC	128 992	0,01	6 399 NOK	Gjensidige Forsikring ASA	118 142	0,01	
Jordanie – Total				6 562 NOK	Kongsberg Gruppen ASA	300 713	0,01	
128 992				19 032 NOK	Mowi ASA	341 072	0,01	
Luxembourg				61 243 NOK	Norsk Hydro ASA	412 480	0,02	
16 268 EUR	ArcelorMittal SA	461 391	0,02	45 715 NOK	Orkla ASA	354 891	0,02	
3 658 EUR	Eurofins Scientific SE	238 327	0,01	3 320 NOK	Salmar ASA	186 077	0,01	
20 959 EUR	Tenaris SA	364 534	0,01	42 234 NOK	Telenor ASA	484 899	0,02	
Luxembourg – Total				9 770 NOK	Yara International ASA	347 482	0,01	
1 064 252				Norvège – Total				
0,04				5 753 059				
Macao				0,24				
140 400 HKD	Sands China Ltd	410 850	0,02					
Macao – Total								
410 850								
0,02								

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Portugal				Espagne (suite)			
219 403	EUR EDP - Energias de Portugal SA	1 103 966	0,04	29 071	EUR Redeia Corp SA	478 809	0,02
26 160	EUR Galp Energia SGPS SA	385 495	0,02	27 352	EUR Repsol SA	406 383	0,02
8 842	EUR Jeronimo Martins SGPS SA	225 039	0,01	113 409	EUR Telefonica SA	442 730	0,02
Portugal – Total				Espagne – Total			
1 714 500				19 951 181			
Singapour				Suède			
94 000	SGD CapitaLand Ascendas REIT	215 920	0,01	15 221	SEK Alfa Laval AB	609 272	0,02
369 460	SGD CapitaLand Integrated Commercial Trust REIT	576 975	0,02	57 030	SEK Assa Abloy AB	1 642 792	0,07
101 506	SGD Capitaland Investment Ltd/Singapore	243 165	0,01	163 570	SEK Atlas Copco AB	2 816 828	0,12
49 100	SGD City Developments Ltd	247 529	0,01	80 352	SEK Atlas Copco AB	1 191 186	0,05
35 720	SGD DBS Group Holdings Ltd	904 712	0,04	15 000	SEK Beijer Ref AB	200 787	0,01
289 100	SGD Genting Singapore Ltd	219 164	0,01	16 242	SEK Boliden AB	506 865	0,02
2 400	SGD Jardine Cycle & Carriage Ltd	54 146	0,00	30 508	SEK Epiroc AB	612 107	0,03
98 400	SGD Keppel Corp Ltd	527 396	0,02	21 847	SEK Epiroc AB	382 404	0,02
241 856	SGD Mapletree Logistics Trust REIT	319 028	0,01	18 449	SEK EQT AB	521 735	0,02
182 475	SGD Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	1 798 328	0,07	34 288	SEK Essity AB	850 578	0,03
4 000	USD Sea Ltd	162 000	0,01	9 893	SEK Evolution AB	1 180 149	0,05
1 221 442	SGD Seatrium Ltd	109 264	0,00	5 286	SEK Fastighets AB Balder	37 514	0,00
51 900	SGD Sembcorp Industries Ltd	208 922	0,01	1 890	SEK Getinge AB	42 065	0,00
48 200	SGD Singapore Airlines Ltd	239 703	0,01	32 676	SEK H & M Hennes & Mauritz AB	572 665	0,02
60 400	SGD Singapore Exchange Ltd	450 104	0,02	68 220	SEK Hexagon AB	818 747	0,03
82 900	SGD Singapore Technologies Engineering Ltd	244 470	0,01	13 055	SEK Holmen AB	551 458	0,02
462 600	SGD Singapore Telecommunications Ltd	866 213	0,04	20 957	SEK Husqvarna AB	172 558	0,01
73 392	SGD United Overseas Bank Ltd	1 582 899	0,07	8 031	SEK Industrivarden AB	261 621	0,01
54 100	SGD Wilmar International Ltd	146 416	0,01	18 850	SEK Industrivarden AB	615 187	0,03
Singapour – Total				Suède – Total			
9 116 354				25 489 282			
Afrique du Sud				Suisse			
24 672	GBP Mondi PLC	483 572	0,02	89 266	CHF ABB Ltd	3 956 065	0,16
Afrique du Sud – Total				Suisse – Total			
483 572				2 339 692			
Espagne				Suisse			
776	EUR Acciona SA	114 266	0,00	2 339	CHF Adecco Group AG	114 692	0,00
12 451	EUR ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	552 361	0,02	26 675	CHF Alcon Inc	2 080 374	0,09
2 474	EUR Aena SME SA	448 470	0,02	1 790	CHF Baloise Holding AG	280 309	0,01
23 729	EUR Amadeus IT Group SA	1 700 650	0,07				
258 358	EUR Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	2 347 661	0,10				
905 503	EUR Banco Santander SA	3 780 498	0,16				
102 917	EUR CaixaBank SA	423 599	0,02				
31 707	EUR Cellnex Telecom SA	1 248 996	0,05				
2 656	EUR Corp ACCIONA Energias Renovables SA	82 385	0,00				
11 849	EUR EDP Renovaveis SA	242 474	0,01				
24 002	EUR Enagas SA	404 733	0,02				
11 765	EUR Endesa SA	239 910	0,01				
2 253	EUR Grifols SA	38 464	0,00				
367 457	EUR Iberdrola SA	4 818 169	0,20				
46 655	EUR Industria de Diseño Textil SA	2 032 122	0,08				
4 979	EUR Naturgy Energy Group SA	148 501	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Suisse (suite)				Royaume-Uni (suite)			
1 711	CHF Banque Cantonale Vaudoise	220 571	0,01	89 596	USD Amcor PLC	863 705	0,04
200	CHF Barry Callebaut AG	337 195	0,01	73 445	GBP Anglo American PLC	1 845 027	0,08
840	CHF BKW AG	149 207	0,01	6 765	USD Aon PLC	1 968 750	0,08
18	CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	215 790	0,01	15 909	USD Aptiv PLC	1 427 355	0,06
4	CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	484 762	0,02	27 108	GBP Ashtead Group PLC	1 887 518	0,08
10 744	USD Chubb Ltd	2 428 144	0,10	19 667	GBP Associated British Foods PLC	593 442	0,02
30 212	CHF Cie Financiere Richemont SA	4 154 980	0,17	88 305	GBP Astrazeneca PLC	11 932 545	0,50
9 615	CHF Clariant AG	141 886	0,01	40 908	GBP Auto Trader Group PLC	376 207	0,02
12 122	GBP Coca-Cola HBC AG	356 194	0,01	161 291	GBP Aviva PLC	893 803	0,04
10 372	EUR DSM-Firmenich AG	1 054 084	0,04	154 628	GBP BAE Systems PLC	2 189 014	0,09
137	CHF EMS-Chemie Holding AG	110 850	0,00	915 013	GBP Barclays PLC	1 793 779	0,07
3 604	USD Garmin Ltd	463 258	0,02	93 246	GBP Barratt Developments PLC	668 762	0,03
2 069	CHF Geberit AG	1 325 006	0,06	6 105	GBP Berkeley Group Holdings PLC	364 851	0,01
591	CHF Givaudan SA	2 446 437	0,10	491 440	GBP BP PLC	2 920 372	0,12
1 016	CHF Helvetia Holding AG	139 909	0,01	83 095	GBP British American Tobacco PLC	2 431 611	0,10
30 514	CHF Holcim AG	2 393 553	0,10	350 729	GBP BT Group PLC	552 627	0,02
13 129	CHF Julius Baer Group Ltd	735 499	0,03	28 203	GBP Bunzl PLC	1 146 906	0,05
2 705	CHF Kuehne & Nagel International AG	931 395	0,04	17 954	GBP Burberry Group PLC	324 091	0,01
9 942	CHF Logitech International SA	942 166	0,04	286 623	GBP Centrica PLC	513 917	0,02
4 213	CHF Lonza Group AG	1 770 496	0,07	47 088	USD CNH Industrial NV	573 532	0,02
59 374	CHF Nestle SA	6 878 820	0,29	12 360	USD Coca-Cola Europacific Partners PLC	824 906	0,03
116 071	CHF Novartis AG	11 704 326	0,49	42 637	GBP Compass Group PLC	1 166 429	0,05
713	CHF Partners Group Holding AG	1 027 587	0,04	7 563	GBP Croda International PLC	486 886	0,02
19 798	CHF Roche Holding AG	5 751 335	0,24	129 409	GBP Diageo PLC	4 711 559	0,20
1 487	CHF Roche Holding AG	461 833	0,02	13 918	GBP Endeavour Mining PLC	311 739	0,01
15 811	CHF Sandoz Group AG	508 342	0,02	26 931	GBP Experian PLC	1 099 299	0,05
1 552	CHF Schindler Holding AG	387 793	0,02	232 116	GBP GSK PLC	4 291 162	0,18
980	CHF Schindler Holding AG	232 294	0,01	186 974	GBP Haleon PLC	766 667	0,03
8 838	CHF SGS SA	761 728	0,03	21 472	GBP Halma PLC	625 188	0,03
16 075	EUR Siemens Energy AG	213 087	0,01	20 215	GBP Hargreaves Lansdown PLC	189 152	0,01
20 421	CHF SIG Group AG	469 490	0,02	1 106 916	GBP HSBC Holdings PLC	8 967 516	0,37
9 634	CHF Sika AG	3 132 924	0,13	59 688	GBP Imperial Brands PLC	1 374 570	0,06
2 778	CHF Sonova Holding AG	905 701	0,04	69 570	GBP Informa PLC	692 829	0,03
38 789	EUR STMicroelectronics NV	1 938 670	0,08	8 291	GBP InterContinental Hotels Group PLC	749 368	0,03
5 750	CHF Straumann Holding AG	926 395	0,04	10 302	GBP Intertek Group PLC	557 627	0,02
728	CHF Swatch Group AG	197 732	0,01	101 192	GBP J Sainsbury PLC	390 353	0,02
463	CHF Swatch Group AG	24 232	0,00	61 577	GBP JD Sports Fashion PLC	130 268	0,01
1 592	CHF Swiss Life Holding AG	1 104 649	0,05	79 977	GBP Kingfisher PLC	248 056	0,01
1 641	CHF Swiss Prime Site AG	175 184	0,01	24 469	GBP Land Securities Group PLC REIT	219 849	0,01
17 356	CHF Swiss Re AG	1 949 959	0,08	370 484	GBP Legal & General Group PLC	1 185 927	0,05
1 334	CHF Swisscom AG	802 001	0,03	14 023	USD Linde PLC	5 759 386	0,24
8 572	USD TE Connectivity Ltd	1 204 366	0,05	3 771 832	GBP Lloyds Banking Group PLC	2 294 054	0,10
3 829	CHF Temenos AG	355 854	0,01	23 335	GBP London Stock Exchange Group PLC	2 758 778	0,11
187 818	CHF UBS Group AG	5 824 333	0,24	109 847	GBP M&G PLC	311 433	0,01
1 334	CHF VAT Group AG	668 070	0,03	22 831	GBP Melrose Industries PLC	165 141	0,01
8 410	CHF Zurich Insurance Group AG	4 392 605	0,18	208 299	GBP National Grid PLC	2 809 408	0,12
Suisse – Total				Suisse – Total			
79 232 132				3,29			
Royaume-Uni				Royaume-Uni			
57 222	GBP 3i Group PLC	1 766 037	0,07	299 525	GBP NatWest Group PLC	837 745	0,03
84 103	GBP abrdn PLC	191 539	0,01	6 665	GBP Next PLC	689 749	0,03
15 136	GBP Admiral Group PLC	517 888	0,02	32 963	GBP Ocado Group PLC	318 689	0,01
				30 588	GBP Pearson PLC	375 976	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				États-Unis (suite)			
8 300	USD Pentair PLC	603 493	0,02	4 101	USD Alnylam Pharmaceuticals Inc	784 972	0,03
4 857	GBP Persimmon PLC	86 003	0,00	150 120	USD Alphabet Inc	21 156 412	0,88
29 319	GBP Phoenix Group Holdings PLC	200 036	0,01	169 820	USD Alphabet Inc	23 722 156	0,99
152 914	GBP Prudential PLC	1 729 461	0,07	59 656	USD Altria Group Inc	2 406 523	0,10
41 709	GBP Reckitt Benckiser Group PLC	2 881 848	0,12	199 380	USD Amazon.com Inc	30 293 797	1,26
105 887	GBP RELX PLC	4 198 024	0,17	8 308	USD Ameren Corp	601 001	0,03
124 709	GBP Rentokil Initial PLC	700 779	0,03	12 915	USD American Electric Power Co Inc	1 048 956	0,04
10 586	AUD Rio Tinto Ltd	979 920	0,04	35 043	USD American Express Co	6 564 956	0,27
32 815	GBP Rio Tinto PLC	2 443 858	0,10	2 003	USD American Financial Group Inc	238 137	0,01
263 825	GBP Rolls-Royce Holdings PLC	1 007 963	0,04	11 200	USD American Homes 4 Rent REIT	402 752	0,02
60 005	GBP Sage Group PLC	896 896	0,04	19 093	USD American International Group Inc	1 293 551	0,05
48 588	GBP Schroders PLC	266 280	0,01	25 926	USD American Tower Corp REIT	5 596 905	0,23
63 152	GBP Segro PLC REIT	713 606	0,03	9 807	USD American Water Works Co Inc	1 294 426	0,05
13 757	GBP Severn Trent PLC	452 290	0,02	2 565	USD Ameriprise Financial Inc	974 264	0,04
380 853	GBP Shell PLC	12 484 922	0,52	7 406	USD AMETEK Inc	1 221 175	0,05
37 169	GBP Smith & Nephew PLC	511 026	0,02	29 820	USD Amgen Inc	8 588 756	0,36
34 745	GBP Smiths Group PLC	781 106	0,03	18 520	USD Amphenol Corp	1 835 888	0,08
3 294	GBP Spirax-Sarco Engineering PLC	441 125	0,02	14 908	USD Analog Devices Inc	2 960 132	0,12
61 956	GBP SSE PLC	1 465 896	0,06	12 093	USD Annaly Capital Management Inc	234 241	0,01
21 233	GBP St James's Place PLC	185 036	0,01	4 802	USD ANSYS Inc	1 742 550	0,07
148 462	GBP Standard Chartered PLC	1 261 603	0,05	7 100	USD APA Corp	254 748	0,01
205 664	GBP Taylor Wimpey PLC	385 536	0,02	16 425	USD Apollo Global Management Inc	1 530 646	0,06
404 071	GBP Tesco PLC	1 496 393	0,06	335 988	USD Apple Inc	64 687 770	2,69
147 993	GBP Unilever PLC	7 169 134	0,30	47 763	USD Applied Materials Inc	7 740 949	0,32
49 345	GBP United Utilities Group PLC	666 478	0,03	30 313	USD Archer-Daniels-Midland Co	2 189 205	0,09
592 112	GBP Vodafone Group PLC	517 507	0,02	6 400	USD Ares Management Corp	761 088	0,03
6 466	GBP Whitbread PLC	301 359	0,01	7 904	USD Arista Networks Inc	1 861 471	0,08
17 398	GBP Wise PLC	193 844	0,01	6 007	USD Arthur J Gallagher & Co	1 350 854	0,06
51 984	GBP Wpp PLC	499 007	0,02	900	USD Aspen Technology Inc	198 135	0,01
Royaume-Uni – Total		128 573 416	5,34	1 201	USD Assurant Inc	202 356	0,01
États-Unis				207 596	USD AT&T Inc	3 483 461	0,14
30 737	USD 3M Co	3 360 169	0,14	4 404	USD Atmos Energy Corp	510 424	0,02
2 500	USD A O Smith Corp	206 100	0,01	13 013	USD Autodesk Inc	3 168 405	0,13
39 281	USD Abbott Laboratories	4 323 660	0,18	23 911	USD Automatic Data Processing Inc	5 570 546	0,23
49 946	USD AbbVie Inc	7 740 132	0,32	590	USD AutoZone Inc	1 525 510	0,06
26 219	USD Adobe Inc	15 642 255	0,65	4 527	USD AvalonBay Communities Inc REIT	847 545	0,04
92 961	USD Advanced Micro Devices Inc	13 703 381	0,57	34 100	USD Avantor Inc	778 503	0,03
5 500	USD AECOM	508 365	0,02	5 703	USD Avery Dennison Corp	1 152 918	0,05
32 726	USD AES Corp	629 976	0,03	4 400	USD Axon Enterprise Inc	1 136 652	0,05
15 725	USD Aflac Inc	1 297 312	0,05	54 907	USD Baker Hughes Co	1 876 721	0,08
17 822	USD Agilent Technologies Inc	2 477 793	0,10	18 004	USD Ball Corp	1 035 590	0,04
6 026	USD Air Products and Chemicals Inc	1 649 919	0,07	210 977	USD Bank of America Corp	7 103 596	0,30
13 500	USD Airbnb Inc	1 837 890	0,08	46 719	USD Bank of New York Mellon Corp	2 431 724	0,10
8 506	USD Akamai Technologies Inc	1 006 685	0,04	13 654	USD Baxter International Inc	527 864	0,02
2 787	USD Albemarle Corp	402 666	0,02	7 737	USD Becton Dickinson and Co	1 886 513	0,08
11 500	USD Albertsons Cos Inc	264 500	0,01	7 000	USD Bentley Systems Inc	365 260	0,02
4 003	USD Alexandria Real Estate Equities Inc REIT	507 460	0,02	37 034	USD Berkshire Hathaway Inc	13 208 546	0,55
2 102	USD Align Technology Inc	575 948	0,02	14 364	USD Best Buy Co Inc	1 124 414	0,05
14 809	USD Alliant Energy Corp	759 702	0,03	2 000	USD Bill.com Holdings Inc	163 180	0,01
6 612	USD Allstate Corp	925 548	0,04	7 968	USD Biogen Inc	2 061 879	0,09
4 114	USD Ally Financial Inc	143 661	0,01	7 847	USD BioMarin Pharmaceutical Inc	756 608	0,03
				574	USD Bio-Rad Laboratories Inc	185 339	0,01

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
4 300	USD Bio-Techne Corp	331 788	0,01	3 253	USD Cintas Corp	1 960 453	0,08
3 607	USD BlackRock Inc	2 928 163	0,12	234 345	USD Cisco Systems Inc	11 839 109	0,49
21 200	USD Blackstone Inc	2 775 504	0,12	53 112	USD Citigroup Inc	2 732 081	0,11
15 642	USD Block Inc	1 209 909	0,05	17 115	USD Citizens Financial Group Inc	567 191	0,02
1 025	USD Booking Holdings Inc	3 635 900	0,15	17 700	USD Cleveland-Cliffs Inc	361 434	0,02
4 700	USD Booz Allen Hamilton Holding Corp	601 177	0,03	6 908	USD Clorox Co	985 012	0,04
14 305	USD BorgWarner Inc	512 834	0,02	8 700	USD Cloudflare Inc	724 362	0,03
12 105	USD Boston Properties Inc REIT	849 408	0,04	9 710	USD CME Group Inc	2 044 926	0,08
47 374	USD Boston Scientific Corp	2 738 691	0,11	23 012	USD CMS Energy Corp	1 336 307	0,06
52 604	USD Bristol-Myers Squibb Co	2 699 111	0,11	232 322	USD Coca-Cola Co	13 690 735	0,57
16 638	USD Broadcom Inc	18 572 167	0,77	14 319	USD Cognizant Technology Solutions Corp	1 081 514	0,04
6 804	USD Broadridge Financial Solutions Inc	1 399 923	0,06	3 500	USD Coinbase Global Inc	608 720	0,03
7 000	CAD Brookfield Renewable Corp	202 472	0,01	19 771	USD Colgate-Palmolive Co	1 575 946	0,07
8 100	USD Brown & Brown Inc	575 991	0,02	120 984	USD Comcast Corp	5 305 148	0,22
5 409	USD Brown-Forman Corp	308 854	0,01	27 413	USD Conagra Brands Inc	785 657	0,03
4 000	USD Builders FirstSource Inc	667 760	0,03	9 700	USD Confluent Inc	226 980	0,01
7 709	USD Bunge Global SA	778 224	0,03	67 621	USD ConocoPhillips	7 848 769	0,33
3 600	USD Burlington Stores Inc	700 128	0,03	9 810	USD Consolidated Edison Inc	892 416	0,04
15 615	USD Cadence Design Systems Inc	4 253 058	0,18	4 405	USD Constellation Brands Inc	1 064 909	0,04
7 500	USD Caesars Entertainment Inc	351 600	0,01	11 100	USD Constellation Energy Corp	1 297 479	0,05
3 303	USD Camden Property Trust REIT	327 955	0,01	3 402	USD Cooper Cos Inc	1 287 453	0,05
10 911	USD Campbell Soup Co	471 683	0,02	25 208	USD Copart Inc	1 235 192	0,05
12 687	USD Capital One Financial Corp	1 663 519	0,07	22 718	USD Corning Inc	691 763	0,03
6 215	USD Cardinal Health Inc	626 472	0,03	19 567	USD Corteva Inc	937 651	0,04
1 200	USD Carlisle Cos Inc	374 916	0,02	13 710	USD CoStar Group Inc	1 198 117	0,05
3 900	USD Carlyle Group Inc	158 691	0,01	12 758	USD Costco Wholesale Corp	8 421 301	0,35
10 605	USD CarMax Inc	813 828	0,03	27 300	USD Coterra Energy Inc	696 696	0,03
11 406	USD Carnival Corp	211 467	0,01	6 400	USD CrowdStrike Holdings Inc	1 634 048	0,07
46 406	USD Carrier Global Corp	2 666 025	0,11	24 815	USD Crown Castle Inc REIT	2 858 440	0,12
2 500	USD Catalent Inc	112 325	0,00	3 000	USD Crown Holdings Inc	276 270	0,01
14 235	USD Caterpillar Inc	4 208 862	0,17	56 887	USD CSX Corp	1 972 272	0,08
3 202	USD Cboe Global Markets Inc	571 749	0,02	7 810	USD Cummins Inc	1 871 042	0,08
16 620	USD Cbre Group Inc	1 547 156	0,06	38 421	USD CVS Health Corp	3 033 722	0,13
4 505	USD CDW Corp	1 024 077	0,04	39 811	USD Danaher Corp	9 209 877	0,38
2 505	USD Celanese Corp	389 202	0,02	4 204	USD Darden Restaurants Inc	690 717	0,03
6 000	USD Celsius Holdings Inc	327 120	0,01	7 500	USD Darling Ingredients Inc	373 800	0,02
8 504	USD Cencora Inc	1 746 552	0,07	8 900	USD Datadog Inc	1 080 282	0,04
19 674	USD Centene Corp	1 460 008	0,06	3 705	USD DaVita Inc	388 136	0,02
14 906	USD CenterPoint Energy Inc	425 864	0,02	1 400	USD Deckers Outdoor Corp	935 802	0,04
6 900	USD Ceridian HCM Holding Inc	463 128	0,02	15 509	USD Deere & Co	6 201 584	0,26
5 833	USD CF Industries Holdings Inc	463 724	0,02	10 192	USD Dell Technologies Inc	779 688	0,03
5 805	USD CH Robinson Worldwide Inc	501 494	0,02	9 807	USD Delta Air Lines Inc	394 536	0,02
1 700	USD Charles River Laboratories International Inc	401 880	0,02	23 200	USD Devon Energy Corp	1 050 960	0,04
43 390	USD Charles Schwab Corp	2 985 232	0,12	10 900	USD Dexcom Inc	1 352 581	0,06
3 692	USD Charter Communications Inc	1 435 007	0,06	6 000	USD Diamondback Energy Inc	930 480	0,04
13 701	USD Cheniere Energy Inc	2 338 898	0,10	1 300	USD Dick's Sporting Goods Inc	191 035	0,01
3 600	USD Chesapeake Energy Corp	276 984	0,01	15 306	USD Digital Realty Trust Inc REIT	2 059 881	0,09
53 100	USD Chevron Corp	7 920 396	0,33	13 411	USD Discover Financial Services	1 507 396	0,06
801	USD Chipotle Mexican Grill Inc	1 831 855	0,08	9 200	USD DocuSign Inc	546 940	0,02
15 105	USD Church & Dwight Co Inc	1 428 329	0,06	6 405	USD Dollar General Corp	870 760	0,04
16 609	USD Cigna Group	4 973 565	0,21	7 700	USD Dollar Tree Inc	1 093 785	0,05
4 048	USD Cincinnati Financial Corp	418 806	0,02	46 462	USD Dominion Energy Inc	2 183 714	0,09

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
801	USD Domino's Pizza Inc	330 196	0,01	33 760	USD Fidelity National Information Services Inc	2 027 963	0,08
8 300	USD DoorDash Inc	820 787	0,03	15 424	USD Fifth Third Bancorp	531 974	0,02
7 395	USD Dover Corp	1 137 425	0,05	400	USD First Citizens BancShares Inc/NC	567 588	0,02
37 500	USD Dow Inc	2 056 500	0,09	5 500	USD First Solar Inc	947 540	0,04
10 106	USD DR Horton Inc	1 535 910	0,06	19 906	USD FirstEnergy Corp	729 754	0,03
11 200	USD DraftKings Inc	394 800	0,02	18 625	USD Fiserv Inc	2 474 145	0,10
6 200	USD Dropbox Inc	182 776	0,01	2 603	USD FleetCor Technologies Inc	735 634	0,03
10 506	USD DTE Energy Co	1 158 392	0,05	3 205	USD FMC Corp	202 075	0,01
41 056	USD Duke Energy Corp	3 984 074	0,17	127 822	USD Ford Motor Co	1 558 150	0,06
11 409	USD Dupont De Nemours Inc	877 694	0,04	17 920	USD Fortinet Inc	1 048 858	0,04
5 700	USD Dynatrace Inc	311 733	0,01	20 730	USD Fortive Corp	1 526 350	0,06
2 304	USD Eastman Chemical Co	206 945	0,01	5 705	USD Fortune Brands Innovations Inc	434 379	0,02
14 515	USD Eaton Corp PLC	3 495 502	0,15	10 100	USD Fox Corp	299 667	0,01
14 931	USD eBay Inc	651 290	0,03	2 767	USD Fox Corp	76 508	0,00
14 501	USD Ecolab Inc	2 876 273	0,12	7 711	USD Franklin Resources Inc	229 711	0,01
11 210	USD Edison International	801 403	0,03	41 900	USD Freeport-McMoRan Inc	1 783 683	0,07
31 518	USD Edwards Lifesciences Corp	2 403 247	0,10	5 900	USD Gaming and Leisure Properties Inc REIT	291 165	0,01
15 509	USD Electronic Arts Inc	2 121 786	0,09	4 803	USD Gartner Inc	2 166 681	0,09
13 508	USD Elevance Health Inc	6 369 832	0,26	10 168	USD GE HealthCare Technologies Inc	786 190	0,03
17 652	USD Eli Lilly & Co	10 289 704	0,43	28 219	USD Gen Digital Inc	643 958	0,03
20 012	USD Emerson Electric Co	1 947 768	0,08	37 805	USD General Electric Co	4 825 052	0,20
7 800	USD Enphase Energy Inc	1 030 692	0,04	32 036	USD General Mills Inc	2 086 825	0,09
3 200	USD Entegris Inc	383 424	0,02	44 100	USD General Motors Co	1 584 072	0,07
5 306	USD Entergy Corp	536 914	0,02	5 707	USD Genuine Parts Co	790 419	0,03
17 509	USD EOG Resources Inc	2 117 714	0,09	68 750	USD Gilead Sciences Inc	5 569 437	0,23
2 100	USD Epam Systems Inc	624 414	0,03	9 499	USD Global Payments Inc	1 206 373	0,05
20 200	USD EQT Corp	780 932	0,03	2 427	USD Globe Life Inc	295 414	0,01
3 550	USD Equifax Inc	877 879	0,04	4 802	USD GoDaddy Inc	509 780	0,02
5 450	USD Equinix Inc REIT	4 389 375	0,18	9 411	USD Goldman Sachs Group Inc	3 630 481	0,15
13 500	USD Equitable Holdings Inc	449 550	0,02	10 500	USD Graco Inc	910 980	0,04
6 900	USD Equity LifeStyle Properties Inc REIT	486 726	0,02	28 728	USD Halliburton Co	1 038 517	0,04
10 612	USD Equity Residential REIT	649 030	0,03	10 207	USD Hartford Financial Services Group Inc	820 439	0,03
300	USD Erie Indemnity Co	100 476	0,00	6 705	USD Hasbro Inc	342 357	0,01
12 500	USD Essential Utilities Inc	466 875	0,02	11 728	USD HCA Healthcare Inc	3 174 535	0,13
1 802	USD Essex Property Trust Inc REIT	446 788	0,02	29 512	USD Healthpeak Properties Inc REIT	584 338	0,02
6 307	USD Estee Lauder Cos Inc	922 399	0,04	1 200	USD HEICO Corp	214 644	0,01
2 800	USD Etsy Inc	226 940	0,01	1 900	USD HEICO Corp	270 636	0,01
7 703	USD Evergy Inc	402 097	0,02	4 411	USD Henry Schein Inc	333 957	0,01
18 906	USD Eversource Energy	1 166 878	0,05	4 104	USD Hershey Co	765 150	0,03
6 200	USD Exact Sciences Corp	458 676	0,02	15 618	USD Hess Corp	2 251 491	0,09
53 682	USD Exelon Corp	1 927 184	0,08	65 498	USD Hewlett Packard Enterprise Co	1 112 156	0,05
2 129	USD Expedia Group Inc	323 161	0,01	3 300	USD HF Sinclair Corp	183 381	0,01
7 411	USD Expeditors International of Washington Inc	942 679	0,04	6 906	USD Hilton Worldwide Holdings Inc	1 257 514	0,05
3 802	USD Extra Space Storage Inc REIT	609 575	0,03	13 365	USD Hologic Inc	954 929	0,04
115 939	USD Exxon Mobil Corp	11 591 581	0,48	57 843	USD Home Depot Inc	20 045 492	0,83
3 102	USD F5 Inc	555 196	0,02	36 700	USD Honeywell International Inc	7 696 357	0,32
2 400	USD FactSet Research Systems Inc	1 144 920	0,05	17 409	USD Hormel Foods Corp	559 003	0,02
1 500	USD Fair Isaac Corp	1 746 015	0,07	26 955	USD Host Hotels & Resorts Inc REIT	524 814	0,02
16 120	USD Fastenal Co	1 044 092	0,04	16 382	USD Howmet Aerospace Inc	886 594	0,04
7 908	USD FedEx Corp	2 000 487	0,08	48 596	USD HP Inc	1 462 254	0,06
7 765	USD Fidelity National Financial Inc	396 170	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
1 400	USD Hubbell Inc	460 502	0,02	8 100	USD Lamb Weston Holdings Inc	875 529	0,04
2 500	USD HubSpot Inc	1 451 350	0,06	13 213	USD Las Vegas Sands Corp	650 212	0,03
3 805	USD Humana Inc	1 741 967	0,07	5 300	USD Lattice Semiconductor Corp	365 647	0,02
72 729	USD Huntington Bancshares Inc	925 113	0,04	1 401	USD Lear Corp	197 835	0,01
1 800	USD Huntington Ingalls Industries Inc	467 352	0,02	5 900	USD Leidos Holdings Inc	638 616	0,03
1 400	USD Hyatt Hotels Corp	182 574	0,01	6 106	USD Lennar Corp	910 038	0,04
4 502	USD IDEX Corp	977 429	0,04	1 401	USD Lennox International Inc	626 976	0,03
4 353	USD IDEXX Laboratories Inc	2 416 133	0,10	2 896	USD Liberty Broadband Corp	233 389	0,01
7 911	USD Illinois Tool Works Inc	2 072 207	0,09	6 503	USD Liberty Media Corp-Liberty Formula One	410 534	0,02
5 005	USD Illumina Inc	696 896	0,03	6 631	USD Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	190 840	0,01
6 306	USD Incyte Corp	395 954	0,02	3 803	USD Live Nation Entertainment Inc	355 961	0,01
27 650	USD Ingersoll Rand Inc	2 138 451	0,09	14 412	USD LKQ Corp	688 749	0,03
3 600	USD Insulet Corp	781 128	0,03	7 505	USD Loews Corp	522 273	0,02
239 777	USD Intel Corp	12 048 794	0,50	33 924	USD Lowe's Cos Inc	7 549 786	0,31
15 827	USD Intercontinental Exchange Inc	2 032 662	0,08	2 000	USD LPL Financial Holdings Inc	455 240	0,02
51 255	USD International Business Machines Corp	8 382 755	0,35	6 000	USD Lucid Group Inc	25 260	0,00
16 422	USD International Flavors & Fragrances Inc	1 329 689	0,06	14 216	USD LyondellBasell Industries NV	1 351 657	0,06
16 712	USD International Paper Co	604 139	0,03	5 009	USD M&T Bank Corp	686 634	0,03
21 712	USD Interpublic Group of Cos Inc	708 680	0,03	2 900	USD Manhattan Associates Inc	624 428	0,03
15 915	USD Intuit Inc	9 947 352	0,41	21 300	USD Marathon Oil Corp	514 608	0,02
10 906	USD Intuitive Surgical Inc	3 679 248	0,15	10 887	USD Marathon Petroleum Corp	1 615 195	0,07
20 805	USD Invitation Homes Inc REIT	709 659	0,03	220	USD Markel Group Inc	312 378	0,01
10 211	USD IQVIA Holdings Inc	2 362 621	0,10	1 700	USD MarketAxess Holdings Inc	497 845	0,02
14 416	USD Iron Mountain Inc REIT	1 008 832	0,04	8 060	USD Marriott International Inc	1 817 611	0,08
5 803	USD J M Smucker Co	733 383	0,03	12 617	USD Marsh & McLennan Cos Inc	2 390 543	0,10
4 100	USD Jabil Inc	522 340	0,02	1 802	USD Martin Marietta Materials Inc	899 036	0,04
1 903	USD Jack Henry & Associates Inc	310 969	0,01	47 811	USD Marvell Technology Inc	2 883 481	0,12
3 700	USD Jacobs Solutions Inc	480 260	0,02	4 711	USD Masco Corp	315 543	0,01
4 801	USD JB Hunt Transport Services Inc	958 952	0,04	47 918	USD Mastercard Inc	20 437 506	0,85
70 617	USD Johnson & Johnson	11 068 509	0,46	8 817	USD Match Group Inc	321 821	0,01
82 703	USD JPMorgan Chase & Co	14 067 780	0,58	12 012	USD McCormick & Co Inc	821 861	0,03
13 913	USD Juniper Networks Inc	410 155	0,02	25 423	USD McDonald's Corp	7 538 174	0,31
15 115	USD Kellanova	845 080	0,04	7 284	USD McKesson Corp	3 372 346	0,14
44 600	USD Kenvue Inc	960 238	0,04	56 567	USD Merck & Co Inc	6 166 934	0,26
55 800	USD Keurig Dr Pepper Inc	1 859 256	0,08	32 153	USD Meta Platforms Inc	11 380 876	0,47
48 434	USD KeyCorp	697 450	0,03	20 315	USD MetLife Inc	1 343 431	0,06
9 011	USD Keysight Technologies Inc	1 433 560	0,06	1 302	USD Mettler-Toledo International Inc	1 579 274	0,07
18 509	USD Kimberly-Clark Corp	2 249 029	0,09	6 415	USD MGM Resorts International	286 622	0,01
13 700	USD Kimco Realty Corp REIT	291 947	0,01	16 114	USD Microchip Technology Inc	1 453 161	0,06
129 413	USD Kinder Morgan Inc	2 282 845	0,09	30 617	USD Micron Technology Inc	2 612 855	0,11
20 200	USD KKR & Co Inc	1 673 570	0,07	299 636	USD Microsoft Corp	112 675 121	4,68
3 905	USD KLA Corp	2 269 976	0,09	3 404	USD Mid-America Apartment Communities Inc REIT	457 702	0,02
4 202	USD Knight-Swift Transportation Holdings Inc	242 245	0,01	10 500	USD Moderna Inc	1 044 225	0,04
44 252	USD Kraft Heinz Co	1 636 439	0,07	2 900	USD Molina Healthcare Inc	1 047 799	0,04
41 527	USD Kroger Co	1 898 199	0,08	9 305	USD Molson Coors Beverage Co	569 559	0,02
7 200	USD L Brands Inc	310 752	0,01	42 048	USD Mondelez International Inc	3 045 537	0,13
11 470	USD L3Harris Technologies Inc	2 415 811	0,10	2 200	USD MongoDB Inc	899 470	0,04
6 003	USD Laboratory Corp of America Holdings	1 364 422	0,06	1 500	USD Monolithic Power Systems Inc	946 170	0,04
7 505	USD Lam Research Corp	5 878 366	0,24	24 412	USD Monster Beverage Corp	1 406 375	0,06
				9 206	USD Moody's Corp	3 595 495	0,15

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
70 191	USD Morgan Stanley	6 545 311	0,27	16 819	USD Progressive Corp	2 678 930	0,11
7 510	USD Mosaic Co	268 332	0,01	21 518	USD Prologis Inc REIT	2 868 349	0,12
3 900	USD Motorola Solutions Inc	1 221 051	0,05	20 311	USD Prudential Financial Inc	2 106 454	0,09
21 606	USD Nasdaq Inc	1 256 173	0,05	6 300	USD PTC Inc	1 102 248	0,05
10 209	USD NetApp Inc	900 025	0,04	29 416	USD Public Service Enterprise Group Inc	1 798 788	0,07
12 613	USD Netflix Inc	6 141 017	0,26	6 303	USD Public Storage REIT	1 922 415	0,08
3 300	USD Neurocrine Biosciences Inc	434 808	0,02	6 903	USD PulteGroup Inc	712 528	0,03
64 926	USD Newmont Corp	2 687 287	0,11	2 004	USD Qorvo Inc	225 670	0,01
12 735	USD News Corp	312 644	0,01	32 747	USD Qualcomm Inc	4 736 199	0,20
117 512	USD NextEra Energy Inc	7 137 679	0,30	7 800	USD Quanta Services Inc	1 683 240	0,07
26 477	USD NIKE Inc	2 874 608	0,12	6 103	USD Quest Diagnostics Inc	841 482	0,04
19 311	USD NiSource Inc	512 707	0,02	6 285	USD Raymond James Financial Inc	700 778	0,03
1 800	USD Nordson Corp	475 488	0,02	18 653	USD Realty Income Corp REIT	1 071 055	0,04
6 407	USD Norfolk Southern Corp	1 514 487	0,06	6 204	USD Regency Centers Corp REIT	415 668	0,02
13 413	USD Northern Trust Corp	1 131 789	0,05	3 320	USD Regeneron Pharmaceuticals Inc	2 915 923	0,12
4 500	USD NRG Energy Inc	232 650	0,01	53 116	USD Regions Financial Corp	1 029 388	0,04
14 010	USD Nucor Corp	2 438 300	0,10	1 700	USD Reliance Steel & Aluminum Co	475 456	0,02
141 507	USD Nvidia Corp	70 077 097	2,91	2 800	USD Repligen Corp	503 440	0,02
95	USD NVR Inc	665 043	0,03	5 002	USD Republic Services Inc	824 880	0,03
24 330	USD Occidental Petroleum Corp	1 452 744	0,06	3 505	USD ResMed Inc	602 930	0,03
3 900	USD Okta Inc	353 067	0,01	3 400	USD Revvity Inc	371 654	0,02
5 501	USD Old Dominion Freight Line Inc	2 229 720	0,09	36 800	USD Rivian Automotive Inc	863 328	0,04
6 309	USD Omnicom Group Inc	545 792	0,02	5 904	USD Robert Half Inc	519 080	0,02
12 309	USD On Semiconductor Corp	1 028 171	0,04	5 600	USD Roblox Corp	256 032	0,01
31 312	USD ONEOK Inc	2 198 729	0,09	6 205	USD Rockwell Automation Inc	1 926 528	0,08
57 962	USD Oracle Corp	6 110 934	0,25	2 700	USD Roku Inc	247 482	0,01
1 851	USD O'Reilly Automotive Inc	1 758 598	0,07	6 100	USD Rollins Inc	266 387	0,01
10 753	USD Otis Worldwide Corp	962 071	0,04	3 004	USD Roper Technologies Inc	1 637 691	0,07
5 705	USD Owens Corning	845 652	0,04	9 412	USD Ross Stores Inc	1 302 527	0,05
15 083	USD Paccar Inc	1 472 855	0,06	6 552	USD Royal Caribbean Cruises Ltd	848 418	0,04
2 801	USD Packaging Corp of America	456 311	0,02	11 700	USD Royalty Pharma PLC	328 653	0,01
27 500	USD Palantir Technologies Inc	472 175	0,02	3 900	USD RPM International Inc	435 357	0,02
17 506	USD Palo Alto Networks Inc	5 162 169	0,21	41 800	USD RTX Corp	3 517 052	0,15
12 087	USD Paramount Global	178 767	0,01	18 399	USD S&P Global Inc	8 105 127	0,34
3 655	USD Parker-Hannifin Corp	1 683 858	0,07	56 057	USD Salesforce Inc	14 750 839	0,61
18 712	USD Paychex Inc	2 228 786	0,09	4 804	USD SBA Communications Corp REIT	1 218 727	0,05
1 500	USD Paycom Software Inc	310 080	0,01	81 373	USD Schlumberger NV	4 234 651	0,18
3 000	USD Paylocity Holding Corp	494 550	0,02	1 300	USD SEI Investments Co	82 615	0,00
28 033	USD PayPal Holdings Inc	1 721 507	0,07	16 430	USD Sempra	1 227 814	0,05
78 795	USD PepsiCo Inc	13 382 543	0,56	11 605	USD ServiceNow Inc	8 198 816	0,34
164 613	USD Pfizer Inc	4 739 208	0,20	7 309	USD Sherwin-Williams Co	2 279 677	0,09
54 700	USD PG&E Corp	986 241	0,04	9 413	USD Simon Property Group Inc REIT	1 342 670	0,06
42 258	USD Philip Morris International Inc	3 975 633	0,17	29 160	USD Sirius XM Holdings Inc	159 505	0,01
24 311	USD Phillips 66	3 236 767	0,13	5 406	USD Skyworks Solutions Inc	607 743	0,03
10 800	USD Pinterest Inc	400 032	0,02	32 300	USD Snap Inc	546 839	0,02
13 105	USD Pioneer Natural Resources Co	2 947 052	0,12	1 802	USD Snap-on Inc	520 490	0,02
24 674	USD Inc PNC Financial Services Group	3 820 769	0,16	7 900	USD Snowflake Inc	1 572 100	0,07
2 600	USD Pool Corp	1 036 646	0,04	33 559	USD Southern Co	2 353 157	0,10
13 409	USD PPG Industries Inc	2 005 316	0,08	11 100	USD Southwest Airlines Co	320 568	0,01
21 621	USD PPL Corp	585 929	0,02	9 105	USD Splunk Inc	1 387 147	0,06
7 209	USD Principal Financial Group Inc	567 132	0,02	5 500	USD SS&C Technologies Holdings Inc	336 105	0,01
66 213	USD Procter & Gamble Co	9 702 853	0,40	3 470	USD Stanley Black & Decker Inc	340 407	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
33 941	USD Starbucks Corp	3 258 675	0,14	5 303	USD Veeva Systems Inc	1 020 934	0,04
17 446	USD State Street Corp	1 351 367	0,06	9 612	USD Ventas Inc REIT	479 062	0,02
8 708	USD Steel Dynamics Inc	1 028 415	0,04	12 637	USD Veralto Corp	1 039 520	0,04
5 200	USD Steris Plc	1 143 220	0,05	2 302	USD VeriSign Inc	474 120	0,02
10 275	USD Stryker Corp	3 076 951	0,13	4 306	USD Verisk Analytics Inc	1 028 531	0,04
2 800	USD Sun Communities Inc REIT	374 220	0,02	236 767	USD Verizon Communications Inc	8 926 116	0,37
900	USD Super Micro Computer Inc	255 834	0,01	7 615	USD Vertex Pharmaceuticals Inc	3 098 467	0,13
22 858	USD Synchrony Financial	872 947	0,04	9 100	USD Vertiv Holdings Co	437 073	0,02
8 505	USD Synopsys Inc	4 379 310	0,18	13 719	USD VF Corp	257 917	0,01
16 815	USD Sysco Corp	1 229 681	0,05	26 412	USD Viatris Inc	286 042	0,01
4 007	USD T Rowe Price Group Inc	431 514	0,02	25 500	USD VICI Properties Inc REIT	812 940	0,03
4 303	USD Take-Two Interactive Software Inc	692 568	0,03	45 468	USD Visa Inc	11 837 594	0,49
10 300	USD Targa Resources Corp	894 761	0,04	10 405	USD Vistra Corp	400 801	0,02
25 920	USD Target Corp	3 691 526	0,15	3 604	USD Vulcan Materials Co	818 144	0,03
1 400	USD Teledyne Technologies Inc	624 806	0,03	8 842	USD W R Berkley Corp	625 306	0,03
2 801	USD Teleflex Inc	698 401	0,03	39 931	USD Walgreens Boots Alliance Inc	1 042 598	0,04
4 500	USD Teradyne Inc	488 340	0,02	44 300	USD Walmart Inc	6 983 895	0,29
81 990	USD Tesla Inc	20 372 875	0,85	52 580	USD Walt Disney Co	4 747 448	0,20
51 759	USD Texas Instruments Inc	8 822 839	0,37	64 456	USD Warner Bros Discovery Inc	733 509	0,03
100	USD Texas Pacific Land Corp	157 245	0,01	12 299	USD Waste Management Inc	2 202 751	0,09
5 500	USD Textron Inc	442 310	0,02	2 905	USD Waters Corp	956 413	0,04
11 307	USD Thermo Fisher Scientific Inc	6 001 643	0,25	1 300	USD Watsco Inc	557 011	0,02
31 246	USD TJX Cos Inc	2 931 187	0,12	18 742	USD WEC Energy Group Inc	1 577 514	0,07
16 771	USD T-Mobile US Inc	2 688 894	0,11	104 000	USD Wells Fargo & Co	5 118 880	0,21
13 900	USD Toast Inc	253 814	0,01	23 412	USD Welltower Inc REIT	2 111 060	0,09
5 700	USD Toro Co	547 143	0,02	4 100	USD West Pharmaceutical Services Inc	1 443 692	0,06
5 704	USD Tractor Supply Co	1 226 531	0,05	18 373	USD Western Digital Corp	962 194	0,04
7 500	USD Trade Desk Inc	539 700	0,02	6 436	USD Westinghouse Air Brake Technologies Corp	816 728	0,03
3 200	USD Tradeweb Markets Inc	290 816	0,01	1 100	USD Westlake Corp	153 956	0,01
1 503	USD TransDigm Group Inc	1 520 435	0,06	5 597	USD WestRock Co	232 387	0,01
6 306	USD TransUnion	433 285	0,02	47 489	USD Weyerhaeuser Co REIT	1 651 193	0,07
6 610	USD Travelers Cos Inc	1 259 139	0,05	37 723	USD Williams Cos Inc	1 313 892	0,05
15 408	USD Trimble Inc	819 706	0,03	12 204	USD Workday Inc	3 369 036	0,14
41 315	USD Truist Financial Corp	1 525 350	0,06	6 900	USD WP Carey Inc REIT	447 189	0,02
9 400	USD Twilio Inc	713 178	0,03	2 503	USD WW Grainger Inc	2 074 211	0,09
800	USD Tyler Technologies Inc	334 496	0,01	2 525	USD Wynn Resorts Ltd	230 053	0,01
9 405	USD Tyson Foods Inc	505 519	0,02	30 332	USD Xcel Energy Inc	1 877 854	0,08
52 100	USD Uber Technologies Inc	3 207 797	0,13	12 711	USD Xylem Inc	1 453 630	0,06
8 409	USD UDR Inc REIT	321 981	0,01	8 406	USD Yum! Brands Inc	1 098 328	0,05
2 409	USD U-Haul Holding Co	169 690	0,01	900	USD Zebra Technologies Corp	245 997	0,01
20 900	USD UiPath Inc	519 156	0,02	3 602	USD Zillow Group Inc	208 412	0,01
2 602	USD Ulta Beauty Inc	1 274 954	0,05	10 603	USD Zimmer Biomet Holdings Inc	1 290 385	0,05
22 025	USD Union Pacific Corp	5 409 780	0,22	25 473	USD Zoetis Inc	5 027 606	0,21
19 722	USD United Parcel Service Inc	3 100 890	0,13	6 800	USD Zoom Video Communications Inc	488 988	0,02
3 702	USD United Rentals Inc	2 122 801	0,09	5 000	USD Zscaler Inc	1 107 800	0,05
1 700	USD United Therapeutics Corp	373 813	0,02				
53 118	USD UnitedHealth Group Inc	27 965 033	1,16		États-Unis – Total	1 487 951 948	61,82
9 600	USD Unity Software Inc	392 544	0,02		Total des actions ordinaires et préférentielles	2 388 628 659	99,23
45 560	EUR Universal Music Group NV	1 298 962	0,05		Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé	2 388 628 659	99,23
46 825	USD US Bancorp	2 026 586	0,08				
2 001	USD Vail Resorts Inc	427 153	0,02				
10 414	USD Valero Energy Corp	1 353 820	0,06				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Autres valeurs mobilières			
Bons de souscription – 0,00 %			
Canada			
750 CAD	Constellation Software Inc*	0	0,00
Canada – Total		0	0,00
Total des bons de souscription		0	0,00
Total des autres valeurs mobilières		0	0,00
TOTAL DES INVESTISSEMENTS		2 388 628 659	99,23

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – 0,02 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	568 000	350 680	196	0,00
Bought AUD / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	3 151 000	1 932 682	15 146	0,00
	Westpac Banking Corporation	108 000	65 131	1 747	0,00
Bought AUD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	897 000	613 121	2 994	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	6 159 000	4 185 701	47 203	0,00
	Westpac Banking Corporation	198 000	132 566	3 723	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	447 000	474 911	6 489	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	3 601 000	3 872 626	604	0,00
	Westpac Banking Corporation	114 000	118 989	4 007	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	1 539 000	206 416	38	0,00
Bought DKK / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	113 113	843 000	31	0,00
Bought EUR / Sold DKK, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	1 527 961	11 382 000	1 228	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	465 105	400 000	3 858	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	BNP Paribas SA	208 625	180 000	993	0,00
	Goldman Sachs International	6 141 918	5 309 000	16 759	0,00
Bought EUR / Sold HKD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	91 162	778 000	1 067	0,00
Bought EUR / Sold HKD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	657 405	5 612 000	7 503	0,00
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	620 168	95 764 000	5 821	0,00
Bought EUR / Sold SEK, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	1 238 274	13 683 000	10 109	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	2 979 228	3 254 500	36 505	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	34 505 507	37 699 500	417 014	0,02
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	26 705 626	29 183 000	317 373	0,01
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	26 708 045	29 183 000	320 046	0,01
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	713 000	820 708	2 337	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	5 016 000	5 768 316	22 423	0,00
Bought HKD / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	5 541 000	636 667	6 312	0,00
Bought ILS / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	675 000	168 117	1 742	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	171 641 000	1 099 766	2 582	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 247 254 000	7 955 644	58 489	0,00
	Westpac Banking Corporation	39 824 000	247 174	9 429	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 985 000	265 370	783	0,00
Bought NOK / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	201 000	114 365	930	0,00
Bought SGD / Sold EUR, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	571 000	389 400	2 720	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	34 108 333	30 740 991	150 293	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,02 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	28 383 334	25 570 341	137 054	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	UBS AG	28 383 333	25 535 097	175 984	0,01
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				1 791 532	0,07

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought DKK / Sold EUR, due 03/01/24	Merrill Lynch International	10 686 000	1 433 491	(7)	(0,00)
Bought EUR / Sold AUD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	193 313	314 000	(714)	(0,00)
Bought EUR / Sold AUD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	2 123 986	3 513 000	(50 834)	(0,00)
Bought EUR / Sold AUD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	1 932 197	3 151 000	(15 277)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	349 961	511 000	(954)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	317 400	470 000	(5 829)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	4 220 414	6 273 000	(95 314)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	4 182 568	6 159 000	(47 258)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	269 758	255 000	(4 988)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	186 942	177 000	(3 796)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	3 912 638	3 730 000	(109 675)	(0,01)
Bought EUR / Sold CHF, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	3 880 063	3 601 000	(267)	(0,00)
Bought EUR / Sold DKK, due 02/02/24	Merrill Lynch International	1 433 927	10 686 000	(39)	(0,00)
Bought EUR / Sold GBP, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	5 762 345	5 016 000	(22 614)	(0,00)
Bought EUR / Sold HKD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	636 377	5 541 000	(6 291)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	167 008	675 000	(2 968)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	168 011	675 000	(1 749)	(0,00)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	651 975	104 786 000	(23 037)	(0,00)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	Goldman Sachs International	7 839 633	1 258 169 000	(264 068)	(0,01)
Bought EUR / Sold JPY, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	7 982 834	1 247 254 000	(57 388)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 03/01/24	Goldman Sachs International	255 553	2 985 000	(11 627)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	265 254	2 985 000	(788)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	113 051	201 000	(2 381)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	114 243	201 000	(931)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	104 648	1 172 000	(696)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	102 262	1 169 000	(3 033)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 03/01/24	Goldman Sachs International	1 178 303	13 439 000	(31 906)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	391 469	571 000	(434)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	389 455	571 000	(2 742)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	25 503 526	28 383 333	(177 865)	(0,01)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Deutsche Bank AG	25 539 969	28 383 334	(137 562)	(0,01)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	UBS AG	25 504 924	28 383 333	(176 319)	(0,01)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	160 000	184 891	(272)	(0,00)
Bought HKD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	849 000	98 860	(479)	(0,00)
Bought SEK / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	2 097 000	188 727	(397)	(0,00)
Bought SEK / Sold EUR, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	13 683 000	1 238 270	(10 124)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,02 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	5 725 000	5 207 156	(27 085)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	2 720 000	2 474 477	(13 432)	(0,00)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(1 311 140)	(0,05)
Total des contrats de change à terme – couverture				480 392	0,02

Contrats à terme standardisés – 0,02 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
MSCI EAFE INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	42	4 730 040	133 000	0,01
S&P EMINI INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	47	11 327 000	253 184	0,01
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			16 057 040	386 184	0,02
Total des contrats à terme standardisés			16 057 040	386 184	0,02
Autres actifs/(passifs) nets				17 558 925	0,73
TOTAL DES ACTIFS NETS				2 407 054 160	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 291 467 USD détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

* Le Conseil d'administration a décidé de fixer le prix du titre à 0,00 conformément aux procédures d'évaluation des investissements en vigueur.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % <i>(suite)</i>			
Brésil				Brésil <i>(suite)</i>			
412 935	BRL Ambev SA	1 167 160	0,19	110 200	BRL Vibra Energia SA	516 336	0,08
60 500	BRL Atacadao SA	155 061	0,02	144 992	BRL WEG SA	1 101 708	0,18
514 722	BRL B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1 541 750	0,25	Brésil – Total			
150 350	BRL Banco Bradesco SA	472 939	0,08	31 619 518			
460 052	BRL Banco Bradesco SA–Preferred Stock	1 618 554	0,26	Îles Caïmans			
110 664	BRL Banco BTG Pactual SA	856 817	0,14	6 000	TWD Alchip Technologies Ltd	640 263	0,10
71 800	BRL Banco do Brasil SA	818 717	0,13	370 000	HKD Bosideng International Holdings Ltd	166 318	0,03
35 500	BRL Banco Santander Brasil SA	236 053	0,04	236 500	HKD China Hongqiao Group Ltd	193 536	0,03
66 644	BRL BB Seguridade Participacoes SA	461 662	0,07	207 000	HKD Country Garden Services Holdings Co Ltd	178 938	0,03
94 660	BRL CCR SA	276 325	0,04	5 800	USD Daqo New Energy Corp–ADR	154 280	0,02
102 238	BRL Centrais Eletricas Brasileiras SA	893 025	0,14	63 000	HKD Haitian International Holdings Ltd	155 875	0,03
24 300	BRL Centrais Eletricas Brasileiras SA–Preferred Stock	235 016	0,04	41 600	USD iQIYI Inc–ADR	203 008	0,03
32 378	BRL Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP	502 374	0,08	224 000	HKD Li Ning Co Ltd	599 548	0,10
134 938	BRL Cia Energetica de Minas Gerais–Preferred Stock	318 900	0,05	41 600	USD TAL Education Group–ADR	525 408	0,08
88 900	BRL Cia Paranaense de Energia–Preferred Stock	189 601	0,03	31 900	USD Vipshop Holdings Ltd–ADR	566 544	0,09
61 799	BRL Cia Siderurgica Nacional SA	250 117	0,04	8 540	USD Weibo Corp–ADR	93 513	0,02
115 284	BRL Cosan SA	459 465	0,07	140 500	HKD Xtep International Holdings Ltd	79 350	0,01
20 900	BRL CPFL Energia SA	165 691	0,03	Îles Caïmans – Total			
19 500	BRL Energisa S/A	216 091	0,03	3 556 581			
75 800	BRL Eneva SA	212 376	0,03	Chili			
18 106	BRL Engie Brasil Energia SA	168 961	0,03	4 277 284	CLP Banco de Chile	506 886	0,08
96 217	BRL Equatorial Energia SA	707 525	0,11	7 558	CLP Banco de Credito e Inversiones SA	206 414	0,03
109 283	BRL Gerdau SA–Preferred Stock	534 536	0,09	6 176 518	CLP Banco Santander Chile	304 128	0,05
392 544	BRL Hapvida Participacoes e Investimentos S/A	359 606	0,06	119 987	CLP Cencosud SA	227 392	0,04
36 348	BRL Hypera SA	267 507	0,04	1 504 177	CLP Cia Sud Americana de Vapores SA	93 184	0,02
428 170	BRL Itau Unibanco Holding SA–Preferred Stock	2 994 264	0,48	105 074	CLP Empresas CMPC SA	204 545	0,03
438 937	BRL Itausa SA–Preferred Stock	937 042	0,15	36 579	CLP Empresas COPEC SA	268 494	0,04
73 500	BRL JBS SA	376 911	0,06	2 007 040	CLP Enel Americas SA	224 081	0,04
71 795	BRL Klabin SA	328 410	0,05	2 587 572	CLP Enel Chile SA	168 863	0,03
86 049	BRL Localiza Rent a Car SA	1 126 630	0,18	81 253	CLP Falabella SA	204 694	0,03
308	BRL Localiza Rent a Car SA	1 268	0,00	16 945 814	CLP Latam Airlines Group SA	185 315	0,03
91 856	BRL Lojas Renner SA	329 408	0,05	13 480	CLP Sociedad Quimica y Minera de Chile SA–Preferred Stock	812 704	0,13
245 168	BRL Magazine Luiza SA	109 017	0,02	Chili – Total			
86 233	BRL Natura & Co Holding SA	299 834	0,05	3 406 700			
323 500	BRL Petroleo Brasileiro SA	2 595 938	0,42	Chine			
419 700	BRL Petroleo Brasileiro SA–Preferred Stock	3 217 562	0,52	44 200	CNY 360 Security Technology Inc	55 928	0,01
64 900	BRL PRIO SA	615 251	0,10	9 200	CNY 37 Interactive Entertainment Network Technology Group Co Ltd	24 303	0,00
104 919	BRL Raia Drogasil SA	635 009	0,10	509	CNY 3peak Inc	10 458	0,00
54 200	BRL Rede D'Or Sao Luiz SA	320 898	0,05	176 400	HKD 3SBio Inc	169 881	0,03
100 760	BRL Rumo SA	476 046	0,08	63 500	HKD AAC Technologies Holdings Inc	188 665	0,03
127 700	BRL Sendas Distribuidora S/A	355 686	0,06	6 500	CNY Accelink Technologies Co Ltd	26 016	0,00
65 705	BRL Suzano SA	752 464	0,12	3 685	CNY Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China	79 490	0,01
39 324	BRL Telefonica Brasil SA	432 616	0,07	8 600	CNY AECC Aero-Engine Control Co Ltd	24 034	0,00
79 866	BRL TIM SA	294 795	0,05	17 200	CNY AECC Aviation Power Co Ltd	90 292	0,02
49 500	BRL TOTVS SA	343 308	0,06	2 464 000	HKD Agricultural Bank of China Ltd	949 810	0,15
68 400	BRL Ultrapar Participacoes SA	373 288	0,06	470 500	CNY Agricultural Bank of China Ltd	240 516	0,04
				48 284	CNY Aier Eye Hospital Group Co Ltd	107 274	0,02
				6 400	CNY AIMA Technology Group Co Ltd	22 506	0,00
				182 000	HKD Air China Ltd	115 140	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
41 300	CNY Air China Ltd	42 573	0,01	21 700	CNY Beijing Enlight Media Co Ltd	24 837	0,00
49 000	HKD Akeso Inc	291 168	0,05	2 460	CNY Beijing Kingsoft Office Software Inc	109 240	0,02
1 448 741	HKD Alibaba Group Holding Ltd	14 026 269	2,25	11 100	CNY Beijing New Building Materials PLC	36 415	0,01
382 000	HKD Aluminum Corp of China Ltd	190 791	0,03	9 400	CNY Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd	25 346	0,00
47 200	CNY Aluminum Corp of China Ltd	37 386	0,01	967	CNY Beijing Roborock Technology Co Ltd	38 426	0,01
1 581	CNY Amlogic Shanghai Co Ltd	13 906	0,00	16 600	CNY Beijing Shiji Information Technology Co Ltd	22 707	0,00
3 000	CNY Angel Yeast Co Ltd	14 822	0,00	6 700	CNY Beijing Tiantan Biological Products Corp Ltd	29 112	0,01
119 500	HKD Anhui Conch Cement Co Ltd	276 079	0,05	9 900	CNY Beijing Tongrentang Co Ltd	74 661	0,01
22 000	CNY Anhui Conch Cement Co Ltd	69 702	0,01	2 030	CNY Beijing United Information Technology Co Ltd	6 275	0,00
9 200	HKD Anhui Gujing Distillery Co Ltd	139 970	0,02	4 060	CNY Beijing Wantai Biological Pharmacy Enterprise Co Ltd	42 837	0,01
2 600	CNY Anhui Gujing Distillery Co Ltd	85 004	0,01	18 000	CNY Beijing Yanjing Brewery Co Ltd	21 816	0,00
16 900	CNY Anhui Jianghuai Automobile Group Corp Ltd	38 330	0,01	191 900	CNY Beijing-Shanghai High Speed Railway Co Ltd	132 594	0,02
2 700	CNY Anhui Kouzi Distillery Co Ltd	17 177	0,00	58 100	CNY Beiqi Foton Motor Co Ltd	22 275	0,00
2 400	CNY Anhui Yingjia Distillery Co Ltd	22 343	0,00	1 900	CNY Bethel Automotive Safety Systems Co Ltd	18 491	0,00
1 100	CNY Anjoy Foods Group Co Ltd	16 160	0,00	3 000	CNY Betta Pharmaceuticals Co Ltd	21 719	0,00
2 000	CNY Anker Innovations Technology Co Ltd	24 886	0,00	1 500	CNY BGI Genomics Co Ltd	10 112	0,00
109 400	HKD ANTA Sports Products Ltd	1 061 279	0,17	18 440	HKD Bilibili Inc	221 038	0,04
5 400	CNY Apelo Pharmaceutical Co Ltd	11 671	0,00	3 185	CNY Bloomage Biotechnology Corp Ltd	29 937	0,01
4 800	CNY Asia - Potash International Investment Guangzhou Co Ltd	17 688	0,00	10 900	CNY BOC International China Co Ltd	15 752	0,00
2 575	CNY ASR Microelectronics Co Ltd	25 473	0,00	95 000	CNY BOE Technology Group Co Ltd	52 032	0,01
1 400	CNY Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd	22 827	0,00	94 000	HKD BYD Co Ltd	2 580 966	0,42
4 000	CNY Autobio Diagnostics Co Ltd	32 025	0,01	9 300	CNY BYD Co Ltd	258 602	0,04
6 600	USD Autohome Inc-ADR	185 196	0,03	74 000	HKD BYD Electronic International Co Ltd	346 851	0,06
21 000	CNY Avary Holding Shenzhen Co Ltd	65 826	0,01	5 700	CNY By-health Co Ltd	13 632	0,00
51 000	CNY AVIC Industry-Finance Holdings Co Ltd	22 275	0,00	2 306	CNY Cambricon Technologies Corp Ltd	43 707	0,01
231 000	HKD AviChina Industry & Technology Co Ltd	99 103	0,02	3 380	CNY Canmax Technologies Co Ltd	12 033	0,00
25 800	CNY BAIC BluePark New Energy Technology Co Ltd	22 211	0,00	17 700	CNY CECEP Solar Energy Co Ltd	13 870	0,00
197 900	HKD Baidu Inc	2 942 440	0,47	34 500	CNY CECEP Wind-Power Corp	14 535	0,00
111 200	CNY Bank of Beijing Co Ltd	70 743	0,01	4 300	CNY CETC Cyberspace Security Technology Co Ltd	13 563	0,00
24 800	CNY Bank of Changsha Co Ltd	23 753	0,00	992 600	HKD CGN Power Co Ltd	259 319	0,04
15 300	CNY Bank of Chengdu Co Ltd	24 194	0,00	2 400	CNY Changchun High & New Technology Industry Group Inc	49 142	0,01
7 084 000	HKD Bank of China Ltd	2 703 488	0,43	118 900	CNY Changjiang Securities Co Ltd	89 835	0,02
299 300	CNY Bank of China Ltd	167 712	0,03	900	CNY Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems Co Ltd	16 572	0,00
813 600	HKD Bank of Communications Co Ltd	507 422	0,08	10 900	CNY Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	45 081	0,01
223 000	CNY Bank of Communications Co Ltd	179 763	0,03	4 400	CNY Chengxin Lithium Group Co Ltd	14 058	0,00
30 700	CNY Bank of Hangzhou Co Ltd	43 157	0,01	12 400	CNY Chifeng Jilong Gold Mining Co Ltd	24 397	0,00
86 230	CNY Bank of Jiangsu Co Ltd	81 015	0,01	9 500	CNY China Baoan Group Co Ltd	15 663	0,00
35 100	CNY Bank of Nanjing Co Ltd	36 379	0,01	909 700	HKD China Cinda Asset Management Co Ltd	90 870	0,02
38 550	CNY Bank of Ningbo Co Ltd	108 873	0,02	829 800	HKD China CITIC Bank Corp Ltd	391 067	0,06
75 990	CNY Bank of Shanghai Co Ltd	63 711	0,01				
159 490	CNY Baoshan Iron & Steel Co Ltd	132 822	0,02				
18 900	CNY Beijing Dabeinong Technology Group Co Ltd	15 819	0,00				
3 900	CNY Beijing Easpring Material Technology Co Ltd	20 922	0,00				
6 000	CNY Beijing E-Hualu Information Technology Co Ltd	26 501	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
196 000 HKD	China Coal Energy Co Ltd	178 215	0,03	240 000 HKD	China Pacific Insurance Group Co Ltd	484 392	0,08
254 000 HKD	China Communications Services Corp Ltd	105 392	0,02	44 400 CNY	China Pacific Insurance Group Co Ltd	148 279	0,02
8 438 000 HKD	China Construction Bank Corp	5 024 838	0,81	2 068 000 HKD	China Petroleum & Chemical Corp	1 083 187	0,17
124 000 CNY	China Construction Bank Corp	113 367	0,02	229 491 CNY	China Petroleum & Chemical Corp	179 839	0,03
28 200 CNY	China CSSC Holdings Ltd	116 592	0,02	400 000 HKD	China Railway Group Ltd	178 266	0,03
83 500 CNY	China Eastern Airlines Corp Ltd	45 499	0,01	104 600 CNY	China Railway Group Ltd	83 438	0,01
184 300 CNY	China Energy Engineering Corp Ltd	54 354	0,01	39 063 CNY	China Railway Signal & Communication Corp Ltd	24 028	0,00
153 000 HKD	China Everbright Bank Co Ltd	45 458	0,01	5 500 CNY	China Rare Earth Resources And Technology Co Ltd	21 373	0,00
258 800 CNY	China Everbright Bank Co Ltd	105 401	0,02	7 448 CNY	China Resources Microelectronics Ltd	46 745	0,01
342 000 HKD	China Feihe Ltd	187 018	0,03	64 600 HKD	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	230 403	0,04
14 200 CNY	China Film Co Ltd	24 409	0,00	144 000 HKD	China Resources Pharmaceutical Group Ltd	94 604	0,02
298 500 HKD	China Galaxy Securities Co Ltd	157 879	0,03	3 400 CNY	China Resources Sanjiu Medical & Pharmaceutical Co Ltd	23 745	0,00
30 200 CNY	China Galaxy Securities Co Ltd	51 107	0,01	564 000 HKD	China Ruyi Holdings Ltd	124 955	0,02
14 600 CNY	China Great Wall Securities Co Ltd	16 403	0,00	296 000 HKD	China Shenhua Energy Co Ltd	1 014 017	0,16
13 700 CNY	China Greatwall Technology Group Co Ltd	19 471	0,00	29 500 CNY	China Shenhua Energy Co Ltd	129 880	0,02
150 800 HKD	China International Capital Corp Ltd	221 317	0,04	44 000 CNY	China Southern Airlines Co Ltd	35 593	0,01
7 800 CNY	China International Capital Corp Ltd	41 680	0,01	227 600 CNY	China State Construction Engineering Corp Ltd	153 745	0,03
13 716 CNY	China Jushi Co Ltd	18 935	0,00	267 900 CNY	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd	164 414	0,03
675 000 HKD	China Life Insurance Co Ltd	874 810	0,14	10 600 CNY	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	124 584	0,02
23 600 CNY	China Life Insurance Co Ltd	93 961	0,02	8 300 HKD	China Tourism Group Duty Free Corp Ltd	81 474	0,01
40 400 HKD	China Literature Ltd	150 299	0,02	4 196 000 HKD	China Tower Corp Ltd	440 635	0,07
314 000 HKD	China Longyuan Power Group Corp Ltd	238 057	0,04	193 800 CNY	China United Network Communications Ltd	119 210	0,02
127 000 HKD	China Medical System Holdings Ltd	225 097	0,04	222 400 HKD	China Vanke Co Ltd	205 637	0,03
7 700 CNY	China Meheco Co Ltd	12 079	0,00	42 500 CNY	China Vanke Co Ltd	62 432	0,01
260 000 HKD	China Mengniu Dairy Co Ltd	699 234	0,11	132 013 CNY	China Yangtze Power Co Ltd	432 714	0,07
340 686 HKD	China Merchants Bank Co Ltd	1 186 732	0,19	2 300 CNY	China Zhenhua Group Science & Technology Co Ltd	19 006	0,00
109 000 CNY	China Merchants Bank Co Ltd	425 860	0,07	308 230 CNY	China Zheshang Bank Co Ltd	109 083	0,02
29 300 CNY	China Merchants Energy Shipping Co Ltd	24 195	0,00	266 000 HKD	Chinasoft International Ltd	204 051	0,03
89 170 CNY	China Merchants Securities Co Ltd	170 811	0,03	3 400 CNY	Chongqing Brewery Co Ltd	31 729	0,01
46 326 CNY	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd	62 001	0,01	57 720 CNY	Chongqing Changan Automobile Co Ltd	136 425	0,02
550 260 HKD	China Minsheng Banking Corp Ltd	186 743	0,03	74 900 CNY	Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd	42 917	0,01
257 422 CNY	China Minsheng Banking Corp Ltd	135 207	0,02	4 100 CNY	Chongqing Taiji Industry Group Co Ltd	26 751	0,00
364 000 HKD	China National Building Material Co Ltd	155 696	0,03	14 250 CNY	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	122 296	0,02
29 300 CNY	China National Chemical Engineering Co Ltd	26 170	0,00	137 224 HKD	CITIC Securities Co Ltd	280 122	0,05
98 200 CNY	China National Nuclear Power Co Ltd	103 432	0,02	63 240 CNY	CITIC Securities Co Ltd	180 912	0,03
3 640 CNY	China National Software & Service Co Ltd	18 536	0,00	399 000 HKD	CMOC Group Ltd	218 188	0,04
16 200 CNY	China Northern Rare Earth Group High-Tech Co Ltd	44 000	0,01	47 100 CNY	CMOC Group Ltd	34 396	0,01
174 000 HKD	China Oilfield Services Ltd	177 820	0,03	3 000 CNY	CNGR Advanced Material Co Ltd	20 699	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
39 800	CNY CNPC Capital Co Ltd	30 183	0,01	122 800	CNY GEM Co Ltd	94 162	0,02
24 580	CNY Contemporary Amperex Technology Co Ltd	563 566	0,09	19 700	CNY Gemdale Corp	12 062	0,00
140 000	HKD COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	132 137	0,02	110 000	HKD Genscript Biotech Corp	279 770	0,05
10 000	CNY COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	17 190	0,00	99 000	HKD GF Securities Co Ltd	118 416	0,02
194 900	HKD Cosco Shipping Holdings Co Ltd	195 935	0,03	27 000	CNY GF Securities Co Ltd	54 185	0,01
63 631	CNY Cosco Shipping Holdings Co Ltd	85 609	0,01	14 000	CNY Giant Network Group Co Ltd	21 903	0,00
1 221 504	HKD Country Garden Holdings Co Ltd	122 017	0,02	3 952	CNY GigaDevice Semiconductor Inc	51 277	0,01
316 000	HKD CRRC Corp Ltd	139 212	0,02	1 650	CNY Ginlong Technologies Co Ltd	16 197	0,00
187 900	CNY CRRC Corp Ltd	138 802	0,02	14 200	CNY GoerTek Inc	41 898	0,01
17 700	CNY CSC Financial Co Ltd	58 813	0,01	16 900	CNY Goldwind Science & Technology Co Ltd	18 987	0,00
730 000	HKD CSPC Pharmaceutical Group Ltd	678 718	0,11	3 600	CNY Gongniu Group Co Ltd	48 358	0,01
75 600	CNY Daqin Railway Co Ltd	76 549	0,01	751	CNY GoodWe Technologies Co Ltd	13 772	0,00
4 147	CNY DaShenLin Pharmaceutical Group Co Ltd	14 502	0,00	6 400	CNY Gotion High-tech Co Ltd	19 324	0,00
71 400	CNY Datang International Power Generation Co Ltd	24 266	0,00	217 500	HKD Great Wall Motor Co Ltd	282 440	0,05
3 780	CNY Do-Fluoride New Materials Co Ltd	8 080	0,00	14 200	CNY Great Wall Motor Co Ltd	50 294	0,01
3 900	CNY Dong-E-E-Jiao Co Ltd	27 013	0,01	14 200	CNY Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	64 154	0,01
20 700	CNY Dongfang Electric Corp Ltd	42 501	0,01	95 500	HKD Greentown China Holdings Ltd	97 230	0,02
238 000	HKD Dongfeng Motor Group Co Ltd	118 565	0,02	15 500	CNY GRG Banking Equipment Co Ltd	26 687	0,00
37 000	HKD East Buy Holding Ltd	131 727	0,02	9 400	CNY Guangdong Haid Group Co Ltd	59 286	0,01
80 498	CNY East Money Information Co Ltd	158 721	0,03	33 600	CNY Guanghui Energy Co Ltd	33 692	0,01
1 700	CNY Eastroc Beverage Group Co Ltd	43 573	0,01	298 800	HKD Guangzhou Automobile Group Co Ltd	138 905	0,02
1 600	CNY Ecovacs Robotics Co Ltd	9 312	0,00	16 600	CNY Guangzhou Automobile Group Co Ltd	20 399	0,00
74 600	HKD ENN Energy Holdings Ltd	549 334	0,09	16 800	CNY Guangzhou Baiyun International Airport Co Ltd	23 074	0,00
8 900	CNY ENN Natural Gas Co Ltd	21 023	0,00	6 400	CNY Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co Ltd	25 706	0,00
5 600	CNY Eoptolink Technology Inc Ltd	38 788	0,01	14 500	CNY Guangzhou Haige Communications Group Inc Co	26 167	0,00
12 383	CNY Eve Energy Co Ltd	73 387	0,01	2 000	CNY Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd	17 574	0,00
19 100	CNY Everbright Securities Co Ltd	41 362	0,01	2 300	CNY Guangzhou Shiyuan Electronic Technology Co Ltd	14 781	0,00
86 100	CNY Fangda Carbon New Material Co Ltd	63 360	0,01	13 400	CNY Guangzhou Tinci Materials Technology Co Ltd	47 197	0,01
9 690	CNY Farasis Energy Gan Zhou Co Ltd	22 195	0,00	15 200	CNY Guolian Securities Co Ltd	23 140	0,00
46 700	HKD Flat Glass Group Co Ltd	98 824	0,02	91 000	CNY Guosen Securities Co Ltd	109 140	0,02
106 875	CNY Focus Media Information Technology Co Ltd	94 859	0,02	47 100	CNY Guotai Junan Securities Co Ltd	98 425	0,02
23 821	CNY Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	126 957	0,02	18 700	CNY Guoyuan Securities Co Ltd	17 937	0,00
227 204	HKD Fosun International Ltd	133 554	0,02	16 600	USD H World Group Ltd-ADR	555 104	0,09
31 700	CNY Founder Securities Co Ltd	35 882	0,01	158 000	HKD Haidilao International Holding Ltd	294 206	0,05
55 500	CNY Foxconn Industrial Internet Co Ltd	117 850	0,02	36 100	CNY Haier Smart Home Co Ltd	106 466	0,02
60 900	HKD Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	296 367	0,05	190 000	HKD Haier Smart Home Co Ltd	536 527	0,09
6 100	CNY Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	32 031	0,01	289 700	CNY Hainan Airlines Holding Co Ltd	55 738	0,01
9 124	CNY GalaxyCore Inc	26 229	0,00	104 000	CNY Hainan Airport Infrastructure Co Ltd	54 040	0,01
50 360	CNY Ganfeng Lithium Group Co Ltd	204 010	0,04	26 800	HKD Haitong Securities Co Ltd	14 312	0,00
600	CNY G-bits Network Technology Xiamen Co Ltd	20 654	0,00	119 800	CNY Haitong Securities Co Ltd	157 645	0,03
117 100	CNY GD Power Development Co Ltd	68 412	0,01	9 000	CNY Hang Zhou Great Star Industrial Co Ltd	28 464	0,01
93 300	HKD GDS Holdings Ltd	108 253	0,02	12 900	CNY Hangzhou Binjiang Real Estate Group Co Ltd	13 171	0,00
468 000	HKD Geely Automobile Holdings Ltd	514 836	0,08				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
3 200	CNY Hangzhou Chang Chuan Technology Co Ltd	17 073	0,00	6 800	CNY Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co Ltd	30 015	0,01
7 996	CNY Hangzhou First Applied Material Co Ltd	27 254	0,01	6 600	CNY Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd	16 916	0,00
6 100	CNY Hangzhou Lion Electronics Co Ltd	23 464	0,00	3 500	CNY Huizhou Desay Sv Automotive Co Ltd	63 658	0,01
3 400	CNY Hangzhou Oxygen Plant Group Co Ltd	13 947	0,00	6 900	CNY Humanwell Healthcare Group Co Ltd	24 090	0,00
7 600	CNY Hangzhou Robam Appliances Co Ltd	23 246	0,00	32 900	CNY Hunan Valin Steel Co Ltd	23 795	0,00
4 000	CNY Hangzhou Silan Microelectronics Co Ltd	12 825	0,00	11 913	CNY Hundsun Technologies Inc	48 116	0,01
3 100	CNY Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	23 932	0,00	32 800	HKD Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	148 278	0,02
116 000	HKD Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd	234 123	0,04	14 012	CNY Hygon Information Technology Co Ltd	139 675	0,02
5 900	CNY Haohua Chemical Science & Technology Co Ltd	25 255	0,00	10 052	CNY IEIT Systems Co Ltd	46 868	0,01
7 700	CNY Hebei Hengshui Laobaigan Liquor Co Ltd	24 385	0,00	12 700	CNY Iflytek Co Ltd	82 721	0,01
7 400	CNY Hebei Yangyuan Zhihui Beverage Co Ltd	22 094	0,00	1 300	CNY Imeik Technology Development Co Ltd	53 736	0,01
9 200	CNY Henan Shenhua Coal & Power Co Ltd	21 706	0,00	5 723 000	HKD Industrial & Commercial Bank of China Ltd	2 799 734	0,45
17 500	CNY Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	65 644	0,01	333 900	CNY Industrial & Commercial Bank of China Ltd	224 144	0,04
60 500	HKD Hengan International Group Co Ltd	225 077	0,04	114 600	CNY Industrial Bank Co Ltd	260 886	0,04
6 200	CNY Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd	11 789	0,00	43 830	CNY Industrial Securities Co Ltd	36 132	0,01
34 800	CNY Hengli Petrochemical Co Ltd	64 365	0,01	3 600	CNY Ingenic Semiconductor Co Ltd	32 685	0,01
24 200	CNY Hengtong Optic-electric Co Ltd	40 579	0,01	223 800	CNY Inner Mongolia BaoTou Steel Union Co Ltd	45 888	0,01
21 086	CNY Hengyi Petrochemical Co Ltd	19 900	0,00	13 500	CNY Inner Mongolia Dian Tou Energy Corp Ltd	27 055	0,01
7 800	CNY Hisense Visual Technology Co Ltd	22 894	0,00	26 500	CNY Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd	13 919	0,00
3 400	CNY Hithink RoyalFlush Information Network Co Ltd	74 904	0,01	42 300	CNY Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	158 909	0,03
5 037	HKD Horizon Construction Development Ltd	2 961	0,00	103 600	USD Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd	159 648	0,03
768	CNY Hoymiles Power Electronics Inc	29 121	0,01	14 900	CNY Inner Mongolia Yuan Xing Energy Co Ltd	12 283	0,00
1 565	CNY Hoyuan Green Energy Co Ltd	7 314	0,00	109 000	HKD Innovent Biologics Inc	596 750	0,10
30 400	CNY Huadian Power International Corp Ltd	21 944	0,00	478	CNY iRay Technology Co Ltd	21 834	0,00
10 700	CNY Huadong Medicine Co Ltd	62 301	0,01	5 200	CNY Isofstone Information Technology Group Co Ltd	33 739	0,01
15 200	CNY Huafon Chemical Co Ltd	14 324	0,00	19 292	CNY JA Solar Technology Co Ltd	56 137	0,01
9 400	CNY Huagong Tech Co Ltd	39 287	0,01	3 000	CNY Jason Furniture Hangzhou Co Ltd	14 746	0,00
13 000	CNY Huaibei Mining Holdings Co Ltd	30 361	0,01	14 600	CNY JCET Group Co Ltd	61 225	0,01
8 320	CNY Hualan Biological Engineering Inc	25 858	0,00	104 750	HKD JD Health International Inc	524 518	0,08
420 000	HKD Huaneng Power International Inc	222 679	0,04	185 800	HKD JD Logistics Inc	232 710	0,04
36 000	CNY Huaneng Power International Inc	38 929	0,01	205 564	HKD JD.com Inc	2 961 619	0,48
92 600	HKD Huatai Securities Co Ltd	116 928	0,02	39 100	CNY Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd	52 715	0,01
62 000	CNY Huatai Securities Co Ltd	121 464	0,02	124 000	HKD Jiangsu Expressway Co Ltd	111 478	0,02
133 700	CNY Huaxia Bank Co Ltd	105 524	0,02	7 156	CNY Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	54 952	0,01
12 500	CNY Huayu Automotive Systems Co Ltd	28 579	0,01	36 498	CNY Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd	231 835	0,04
4 700	CNY Hubei Feilihua Quartz Glass Co Ltd	24 132	0,00	7 400	CNY Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd	50 663	0,01
				6 900	CNY Jiangsu Nwha Pharmaceutical Co Ltd	26 280	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
2 600	CNY Jiangsu Pacific Quartz Co Ltd	31 723	0,01	451 220	HKD Meituan	4 732 622	0,76
5 900	CNY Jiangsu Phoenix Publishing & Media Corp Ltd	7 300	0,00	98 300	CNY Metallurgical Corp of China Ltd	42 243	0,01
10 200	CNY Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	157 428	0,03	84 117	HKD Microport Scientific Corp	90 704	0,02
2 700	CNY Jiangsu Yangnong Chemical Co Ltd	23 934	0,00	11 800	CNY Ming Yang Smart Energy Group Ltd	20 781	0,00
5 000	CNY Jiangsu Yoke Technology Co Ltd	39 133	0,01	37 600	HKD MINISO Group Holding Ltd	193 332	0,03
4 400	CNY Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd	21 368	0,00	68 000	HKD Minth Group Ltd	137 419	0,02
12 400	CNY Jiangsu Zhongtian Technology Co Ltd	21 750	0,00	6 241	CNY Montage Technology Co Ltd	51 501	0,01
77 000	HKD Jiangxi Copper Co Ltd	108 865	0,02	30 450	CNY Muyuan Foods Co Ltd	176 099	0,03
36 800	CNY Jiangxi Copper Co Ltd	92 302	0,02	41 745	CNY NARI Technology Co Ltd	130 853	0,02
5 500	CNY Jiangxi Special Electric Motor Co Ltd	10 427	0,00	26 601	CNY National Silicon Industry Group Co Ltd	64 704	0,01
18 000	CNY Jinduicheng Molybdenum Co Ltd	23 888	0,00	3 000	CNY NAURA Technology Group Co Ltd	103 521	0,02
600	CNY JiuGui Liquor Co Ltd	6 164	0,00	17 900	CNY NavInfo Co Ltd	22 373	0,00
28 700	CNY Jizhong Energy Resources Co Ltd	28 778	0,01	171 000	HKD NetEase Inc	3 079 010	0,49
25 000	CNY Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd	24 612	0,00	88 700	HKD New China Life Insurance Co Ltd	172 889	0,03
4 500	CNY Jonjee Hi-Tech Industrial And Commercial Holding Co Ltd	17 758	0,00	4 800	CNY New China Life Insurance Co Ltd	20 985	0,00
4 200	USD JOYY Inc-ADR	166 740	0,03	15 500	CNY New Hope Liuhe Co Ltd	20 288	0,00
2 500	CNY Juwei Food Co Ltd	9 430	0,00	129 100	HKD New Oriental Education & Technology Group Inc	913 457	0,15
8 200	CNY Juneyao Airlines Co Ltd	13 819	0,00	4 800	CNY Ninestar Corp	15 255	0,00
20 600	USD Kanzhun Ltd	342 166	0,06	1 080	CNY Ningbo Deye Technology Co Ltd	12 725	0,00
55 700	USD KE Holdings Inc	902 897	0,15	6 200	CNY Ningbo Joyson Electronic Corp	15 638	0,00
6 600	CNY Keda Industrial Group Co Ltd	9 779	0,00	5 100	CNY Ningbo Orient Wires & Cables Co Ltd	30 619	0,01
262 000	HKD Kingdee International Software Group Co Ltd	381 833	0,06	3 101	CNY Ningbo Ronbay New Energy Technology Co Ltd	17 333	0,00
15 200	CNY Kingnet Network Co Ltd	23 844	0,00	19 700	CNY Ningbo Shanshan Co Ltd	37 681	0,01
91 200	HKD Kingsoft Corp Ltd	281 476	0,05	6 700	CNY Ningbo Tuopu Group Co Ltd	69 159	0,01
204 000	HKD Kuaishou Technology	1 383 330	0,22	46 200	CNY Ningxia Baofeng Energy Group Co Ltd	95 831	0,02
9 400	CNY Kuang-Chi Technologies Co Ltd	19 511	0,00	117 800	USD NIO Inc-ADR	1 068 446	0,17
7 200	CNY Kunlun Tech Co Ltd	37 817	0,01	170 000	HKD Nongfu Spring Co Ltd	982 961	0,16
7 000	CNY Kweichow Moutai Co Ltd	1 696 767	0,27	4 200	CNY North Industries Group Red Arrow Co Ltd	8 281	0,00
6 400	CNY LB Group Co Ltd	15 396	0,00	44 600	CNY Offcn Education Technology Co Ltd	25 555	0,00
608 000	HKD Lenovo Group Ltd	850 268	0,14	30 500	CNY Offshore Oil Engineering Co Ltd	25 443	0,00
6 300	CNY Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd	14 298	0,00	2 500	CNY Oppein Home Group Inc	24 440	0,00
100 100	HKD Li Auto Inc	1 885 716	0,30	38 744	CNY Orient Securities Co Ltd/China	47 338	0,01
404 400	CNY Liaoning Port Co Ltd	82 350	0,01	1 880	CNY Ovctek China Inc	5 962	0,00
19 800	CNY Lingyi iTech Guangdong Co	18 797	0,00	63 400	CNY Pangang Group Vanadium Titanium & Resources Co Ltd	29 204	0,01
5 200	CNY Livzon Pharmaceutical Group Inc	25 567	0,00	53 200	USD PDD Holdings Inc-ADR	7 783 692	1,25
185 837	HKD Longfor Group Holdings Ltd	297 490	0,05	6 600	CNY People.cn Co Ltd	25 934	0,00
42 367	CNY LONGi Green Energy Technology Co Ltd	136 253	0,02	747 000	HKD People's Insurance Co Group of China Ltd	229 594	0,04
17 075	USD Lufax Holding Ltd	52 420	0,01	83 300	CNY People's Insurance Co Group of China Ltd	56 621	0,01
8 300	CNY Luzhou Laojiao Co Ltd	209 138	0,03	9 300	CNY Perfect World Co Ltd/China	15 464	0,00
11 900	CNY Mango Excellent Media Co Ltd	42 114	0,01	5 625	CNY Pharmaron Beijing Co Ltd	22 893	0,00
2 891	CNY Maxscend Microelectronics Co Ltd	57 247	0,01	560 310	HKD PICC Property & Casualty Co Ltd	665 895	0,11
19 200	CNY Meihua Holdings Group Co Ltd	25 751	0,00	105 100	CNY Ping An Bank Co Ltd	138 596	0,02
14 100	CNY Meinian Onehealth Healthcare Holdings Co Ltd	11 901	0,00	60 200	HKD Ping An Healthcare and Technology Co Ltd	136 921	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
603 500	HKD Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2 732 098	0,44	59 040	USD Shanghai Baosight Software Co Ltd	125 165	0,02
44 300	CNY Ping An Insurance Group Co of China Ltd	250 722	0,04	536	CNY Shanghai BOCHU Electronic Technology Corp Ltd	19 053	0,00
1 237	CNY Piotech Inc	40 182	0,01	12 400	CNY Shanghai Construction Group Co Ltd	4 075	0,00
65 900	CNY Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	91 623	0,02	49 100	CNY Shanghai Electric Group Co Ltd	28 754	0,01
41 200	HKD Pop Mart International Group Ltd	106 844	0,02	13 700	CNY Shanghai Electric Power Co Ltd	16 277	0,00
731 000	HKD Postal Savings Bank of China Co Ltd	349 185	0,06	54 000	HKD Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	117 563	0,02
184 600	CNY Postal Savings Bank of China Co Ltd	112 773	0,02	8 200	CNY Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	28 824	0,01
105 600	CNY Power Construction Corp of China Ltd	72 520	0,01	2 300	CNY Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd	12 478	0,00
967	CNY Pylon Technologies Co Ltd	14 395	0,00	10 900	CNY Shanghai International Airport Co Ltd	50 179	0,01
5 802	CNY Qi An Xin Technology Group Inc	32 666	0,01	6 900	CNY Shanghai Jinjiang International Hotels Co Ltd	28 974	0,01
11 200	USD Qifu Technology Inc	177 184	0,03	4 592	CNY Shanghai Junshi Biosciences Co Ltd	26 976	0,01
29 900	CNY Qinghai Salt Lake Industry Co Ltd	66 975	0,01	54 800	CNY Shanghai Lingang Holdings Corp Ltd	77 345	0,01
9 900	CNY Risen Energy Co Ltd	24 539	0,00	6 200	CNY Shanghai M&G Stationery Inc	32 695	0,01
2 600	CNY Rockchip Electronics Co Ltd	23 150	0,00	3 300	CNY Shanghai Moons' Electric Co Ltd	30 518	0,01
58 500	CNY Rongsheng Petrochemical Co Ltd	85 031	0,01	87 900	HKD Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	128 554	0,02
10 600	CNY Sailun Group Co Ltd	17 492	0,00	3 000	CNY Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	7 049	0,00
37 100	CNY Sanan Optoelectronics Co Ltd	72 162	0,01	142 090	CNY Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd	132 101	0,02
1 000	CNY Sangfor Technologies Inc	10 152	0,00	7 540	CNY Shanghai Putailai New Energy Technology Co Ltd	22 163	0,00
109 000	HKD Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd	105 391	0,02	67 100	CNY Shanghai RAAS Blood Products Co Ltd	75 387	0,01
62 500	CNY Sany Heavy Industry Co Ltd	120 864	0,02	77 100	CNY Shanghai Rural Commercial Bank Co Ltd	62 151	0,01
21 094	CNY Satellite Chemical Co Ltd	43 695	0,01	6 852	CNY Shanghai United Imaging Healthcare Co Ltd	131 842	0,02
25 800	CNY SDIC Capital Co Ltd	24 421	0,00	8 791	CNY Shanghai Yuyuan Tourist Mart Group Co Ltd	7 667	0,00
48 500	CNY SDIC Power Holdings Co Ltd	89 772	0,02	12 000	CNY Shanxi Coal International Energy Group Co Ltd	29 509	0,01
6 500	CNY Seazen Holdings Co Ltd	10 416	0,00	26 900	CNY Shanxi Coking Coal Energy Group Co Ltd	37 324	0,01
10 400	CNY Seres Group Co Ltd	111 294	0,02	19 600	CNY Shanxi Lu'an Environmental Energy Development Co Ltd	60 309	0,01
26 100	CNY SF Holding Co Ltd	148 083	0,02	28 700	CNY Shanxi Meijin Energy Co Ltd	26 844	0,00
2 047	CNY SG Micro Corp	25 588	0,00	17 500	CNY Shanxi Taigang Stainless Steel Co Ltd	9 167	0,00
55 100	CNY Shaanxi Coal Industry Co Ltd	161 649	0,03	6 500	CNY Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	210 621	0,03
10 950	CNY Shan Xi Hua Yang Group New Energy Co Ltd	15 009	0,00	3 000	CNY Shede Spirits Co Ltd	40 741	0,01
14 420	CNY Shandong Gold Mining Co Ltd	46 314	0,01	6 600	CNY Shenghe Resources Holding Co Ltd	9 436	0,00
84 000	HKD Shandong Gold Mining Co Ltd	159 425	0,03	9 500	CNY Shengyi Technology Co Ltd	24 428	0,00
8 710	CNY Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd	33 748	0,01	1 820	CNY Shennan Circuits Co Ltd	18 145	0,00
2 400	CNY Shandong Linglong Tyre Co Ltd	6 481	0,00	177 800	CNY Shenwan Hongyuan Group Co Ltd	110 866	0,02
268 000	CNY Shandong Nanshan Aluminum Co Ltd	110 654	0,02				
15 000	CNY Shandong Sun Paper Industry JSC Ltd	25 637	0,00				
236 000	HKD Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	229 999	0,04				
13 440	CNY Shanghai Aiko Solar Energy Co Ltd	33 295	0,01				
4 900	CNY Shanghai Bairun Investment Holding Group Co Ltd	16 935	0,00				
7 909	CNY Shanghai Baosight Software Co Ltd	54 203	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
5 040	CNY Shenzhen Capchem Technology Co Ltd	33 479	0,01	5 400	CNY Sunwoda Electronic Co Ltd	11 193	0,00
1 280	CNY Shenzhen Dynanonic Co Ltd	10 971	0,00	3 387	CNY SUPCON Technology Co Ltd	21 571	0,00
23 200	CNY Shenzhen Energy Group Co Ltd	21 015	0,00	4 700	CNY Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd	12 000	0,00
11 919	CNY Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	105 689	0,02	768	CNY Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd	13 968	0,00
10 600	CNY Shenzhen Kaifa Technology Co Ltd	24 131	0,00	3 100	CNY Suzhou TFC Optical Communication Co Ltd	39 844	0,01
3 700	CNY Shenzhen Kangtai Biological Products Co Ltd	14 108	0,00	98 900	CNY TCL Technology Group Corp	59 724	0,01
900	CNY Shenzhen Kedali Industry Co Ltd	10 675	0,00	24 375	CNY TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd	53 538	0,01
6 700	CNY Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	273 435	0,04	593 100	HKD Tencent Holdings Ltd	22 300 448	3,58
3 000	CNY Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co Ltd	32 947	0,01	70 600	USD Tencent Music Entertainment Group-ADR	636 106	0,10
3 700	CNY Shenzhen Salubris Pharmaceuticals Co Ltd	16 971	0,00	2 000	CNY Thunder Software Technology Co Ltd	22 487	0,00
1 500	CNY Shenzhen SC New Energy Technology Corp	15 591	0,00	10 100	CNY Tianqi Lithium Corp	79 134	0,01
9 300	CNY Shenzhen SED Industry Co Ltd	27 663	0,01	15 200	CNY Tianshan Aluminum Group Co Ltd	12 829	0,00
4 400	CNY Shenzhen Senior Technology Material Co Ltd	9 528	0,00	186 000	HKD Tingyi Cayman Islands Holding Corp	226 767	0,04
4 417	CNY Shenzhen Transsion Holdings Co Ltd	85 851	0,01	8 400	CNY Titan Wind Energy Suzhou Co Ltd	13 684	0,00
68 400	HKD Shenzhen International Group Holdings Ltd	704 274	0,11	116 800	HKD Tongcheng Travel Holdings Ltd	215 993	0,04
8 600	CNY Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co Ltd	27 863	0,01	8 400	CNY TongFu Microelectronics Co Ltd	27 274	0,01
24 500	CNY Sichuan Chuantou Energy Co Ltd	52 024	0,01	7 100	CNY Tongkun Group Co Ltd	15 086	0,00
42 600	CNY Sichuan Hebang Biotechnology Co Ltd	14 119	0,00	5 700	CNY Tongling Nonferrous Metals Group Co Ltd	2 626	0,00
8 700	CNY Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd	35 494	0,01	28 300	CNY Tongwei Co Ltd	99 479	0,02
61 460	CNY Sichuan Road and Bridge Group Co Ltd	64 648	0,01	900	CNY Topchoice Medical Corp	9 663	0,00
2 100	CNY Sichuan Swellfun Co Ltd	17 332	0,00	166 000	HKD Topsports International Holdings Ltd	129 253	0,02
3 100	CNY Sieyuan Electric Co Ltd	22 656	0,00	89 000	HKD TravelSky Technology Ltd	153 870	0,03
31 000	TWD Silergy Corp	505 042	0,08	48 700	HKD Trip.com Group Ltd	1 731 323	0,28
18 300	CNY Sinoma International Engineering Co	24 004	0,00	56 000	HKD Tsingtao Brewery Co Ltd	375 793	0,06
4 400	CNY Sinoma Science & Technology Co Ltd	9 837	0,00	5 900	CNY Tsingtao Brewery Co Ltd	61 936	0,01
2 100	CNY Sinomine Resource Group Co Ltd	11 003	0,00	5 379	CNY Unigroup Guoxin Microelectronics Co Ltd	50 953	0,01
126 400	HKD Sinopharm Group Co Ltd	331 032	0,05	115 000	HKD Uni-President China Holdings Ltd	81 737	0,01
2 352	CNY Skshu Paint Co Ltd	15 726	0,00	10 640	CNY Unisplendour Corp Ltd	28 914	0,01
176 000	HKD Smoore International Holdings Ltd	146 506	0,02	12 100	CNY Universal Scientific Industrial Shanghai Co Ltd	25 676	0,00
13 680	CNY Songcheng Performance Development Co Ltd	18 962	0,00	3 193	CNY Verisilicon Microelectronics Shanghai Co Ltd	22 403	0,00
22 500	CNY SooChow Securities Co Ltd	23 098	0,00	8 900	CNY Walvax Biotechnology Co Ltd	29 385	0,01
41 000	CNY Southwest Securities Co Ltd	23 550	0,00	14 200	CNY Wanda Film Holding Co Ltd	25 965	0,00
9 800	CNY Spring Airlines Co Ltd	69 090	0,01	17 700	CNY Wanhua Chemical Group Co Ltd	190 955	0,03
1 100	CNY StarPower Semiconductor Ltd	27 961	0,01	448 000	HKD Want Want China Holdings Ltd	270 801	0,04
8 100	CNY Sungrow Power Supply Co Ltd	99 638	0,02	189 000	HKD Weichai Power Co Ltd	315 623	0,05
67 100	HKD Sunny Optical Technology Group Co Ltd	608 824	0,10	29 600	CNY Weichai Power Co Ltd	56 742	0,01
4 300	CNY Sunresin New Materials Co Ltd	32 042	0,01	3 040	CNY Weihai Guangwei Composites Co Ltd	11 386	0,00
				37 100	CNY Wens Foodstuffs Group Co Ltd	104 517	0,02
				14 900	CNY Western Mining Co Ltd	29 860	0,01
				116 900	CNY Western Securities Co Ltd	104 577	0,02
				1 909	CNY Western Superconducting Technologies Co Ltd	14 271	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
7 210	CNY Will Semiconductor Co Ltd Shanghai	108 050	0,02	26 700	CNY Zhejiang China Commodities City Group Co Ltd	27 448	0,01
7 800	CNY Wingtech Technology Co Ltd	46 347	0,01	9 100	CNY Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	27 489	0,01
28 600	CNY Wuchan Zhongda Group Co Ltd	17 793	0,00	20 100	CNY Zhejiang Dahua Technology Co Ltd	52 081	0,01
14 778	CNY Wuhan Guide Infrared Co Ltd	15 150	0,00	3 400	CNY Zhejiang Dingli Machinery Co Ltd	24 433	0,00
21 300	CNY Wuliangye Yibin Co Ltd	419 712	0,07	168 360	HKD Zhejiang Expressway Co Ltd	112 333	0,02
15 500	CNY WJUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd	48 150	0,01	6 100	CNY Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd	12 567	0,00
34 445	HKD WuXi AppTec Co Ltd	350 469	0,06	9 320	CNY Zhejiang Huayou Cobalt Co Ltd	43 101	0,01
13 696	CNY WuXi AppTec Co Ltd	139 949	0,02	9 600	CNY Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd	59 442	0,01
891	CNY Wuxi Autowell Technology Co Ltd	11 324	0,00	8 600	CNY Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co Ltd	29 240	0,01
333 500	HKD Wuxi Biologics Cayman Inc	1 264 204	0,20	7 800	CNY Zhejiang Juhua Co Ltd	18 063	0,00
63 200	CNY XCMG Construction Machinery Co Ltd	48 461	0,01	45 000	HKD Zhejiang Leapmotor Technology Co Ltd	205 736	0,03
11 500	CNY Xiamen C & D Inc	15 553	0,00	14 112	CNY Zhejiang NHU Co Ltd	33 612	0,01
1 700	CNY Xiamen Faratronic Co Ltd	22 108	0,00	2 800	CNY Zhejiang Supor Co Ltd	20 845	0,00
1 336 200	HKD Xiaomi Corp	2 669 474	0,43	4 300	CNY Zhejiang Weiming Environment Protection Co Ltd	9 662	0,00
14 575	CNY Xinjiang Daqo New Energy Co Ltd	60 526	0,01	5 800	CNY Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd	11 786	0,00
458 514	HKD Xinyi Solar Holdings Ltd	267 761	0,04	13 500	CNY Zheshang Securities Co Ltd	19 774	0,00
84 800	HKD XPeng Inc	615 756	0,10	66 400	HKD ZhongAn Online P&C Insurance Co Ltd	151 702	0,03
114 000	HKD Yadea Group Holdings Ltd	200 304	0,03	4 400	CNY Zhongji Innolight Co Ltd	69 770	0,01
223 000	HKD Yankuang Energy Group Co Ltd	423 807	0,07	79 500	HKD Zhongsheng Group Holdings Ltd	190 184	0,03
15 600	CNY Yankuang Energy Group Co Ltd	43 400	0,01	36 200	CNY Zhongtai Securities Co Ltd	34 875	0,01
3 800	CNY Yantai Jerih Oilfield Services Group Co Ltd	15 001	0,00	53 900	HKD Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	153 930	0,03
4 340	CNY Yealink Network Technology Corp Ltd	18 011	0,00	2 381	CNY Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	12 148	0,00
3 640	CNY Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd	20 468	0,00	8 500	CNY Zhuzhou Kibing Group Co Ltd	8 165	0,00
13 500	CNY Yihai Kerry Arawana Holdings Co Ltd	63 285	0,01	84 600	CNY Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	77 583	0,01
10 700	CNY Yintai Gold Co Ltd	22 540	0,00	66 432	HKD ZTE Corp	148 373	0,02
59 500	CNY Yonghui Superstores Co Ltd	23 564	0,00	26 300	CNY ZTE Corp	97 804	0,02
2 470	CNY YongXing Special Materials Technology Co Ltd	18 111	0,00	35 400	USD ZTO Express Cayman Inc-ADR	753 312	0,12
12 520	CNY Yonyou Network Technology Co Ltd	31 280	0,01	Chine – Total		150 954 759	24,23
22 400	CNY YTO Express Group Co Ltd	38 662	0,01	Colombie			
9 880	CNY Yunda Holding Co Ltd	10 351	0,00	24 405	COP Bancolombia SA	209 150	0,04
13 400	CNY Yunnan Aluminium Co Ltd	22 996	0,00	35 042	COP Bancolombia SA-Preferred Stock	270 639	0,04
9 660	CNY Yunnan Baiyao Group Co Ltd	66 678	0,01	32 505	COP Interconexion Electrica SA ESP	129 886	0,02
2 100	CNY Yunnan Botanee Bio-Technology Group Co Ltd	20 105	0,00	Colombie – Total		609 675	0,10
35 200	CNY Yunnan Chihong Zinc&Germanium Co Ltd	24 964	0,00	Chypre			
6 800	CNY Yunnan Energy New Material Co Ltd	54 262	0,01	6 121	USD TCS Group Holding PLC-GDR*	0	0,00
8 200	CNY Yunnan Yuntianhua Co Ltd	17 965	0,00	Chypre – Total		0	0,00
13 700	CNY Yutong Bus Co Ltd	25 493	0,00	République tchèque			
90 960	HKD Zai Lab Ltd	250 449	0,04	15 182	CZK CEZ AS	651 106	0,10
6 500	CNY Zangge Mining Co Ltd	23 131	0,00	7 185	CZK Komerční Banka AS	232 914	0,04
3 500	CNY Zhangzhou Pientzhuang Pharmaceutical Co Ltd	118 946	0,02	30 609	CZK Moneta Money Bank AS	128 190	0,02
120 500	HKD Zhaojin Mining Industry Co Ltd	149 843	0,02	République tchèque – Total		1 012 210	0,16
31 100	CNY Zhejiang Century Huatong Group Co Ltd	22 537	0,00				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Égypte				Hong Kong (suite)			
197 519	EGP Commercial International Bank - Egypt (CIB)	281 157	0,05	189 000	HKD Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	281 253	0,04
51 770	EGP Eastern Co SAE	28 358	0,00	546 000	HKD CITIC Ltd	545 402	0,09
73 530	EGP EFG Holding S.A.E.	23 920	0,00	136 237	HKD Cosco Shipping Ports Ltd	98 402	0,02
Égypte – Total				136 000 HKD Far East Horizon Ltd			
		333 435	0,05			106 939	0,02
Grèce				266 000 HKD Guangdong Investment Ltd			
209 235	EUR Alpha Services and Holdings SA	355 711	0,06	56 000	HKD Hua Hong Semiconductor Ltd	135 400	0,02
243 285	EUR Eurobank Ergasias Services and Holdings SA	432 679	0,07	67 500	HKD Kingboard Holdings Ltd	161 477	0,03
1 608	EUR FF Group*	0	0,00	87 000	HKD Kingboard Laminates Holdings Ltd	74 872	0,01
18 116	EUR Hellenic Telecommunications Organization SA	258 153	0,04	364 000	HKD Kunlun Energy Co Ltd	328 174	0,05
6 024	EUR JUMBO SA	167 159	0,02	12 500	HKD Orient Overseas International Ltd	174 488	0,03
6 466	EUR Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	169 710	0,03	978 000	HKD Sino Biopharmaceutical Ltd	434 608	0,07
7 035	EUR Mytilineos SA	285 204	0,04	64 000	HKD Sinotruk Hong Kong Ltd	125 565	0,02
70 006	EUR National Bank of Greece SA	486 419	0,08	35 000	HKD Vinda International Holdings Ltd	101 972	0,02
10 204	EUR OPAP SA	173 248	0,03	143 520	HKD Yuexiu Property Co Ltd	116 896	0,02
65 515	EUR Piraeus Financial Holdings SA	231 588	0,04	Hong-Kong – Total			
19 549	EUR Public Power Corp SA	240 998	0,04			7 687 378	1,23
Grèce – Total				Hongrie			
		2 800 869	0,45	42 850	HUF MOL Hungarian Oil & Gas PLC	349 977	0,06
Hong Kong				22 470 HUF OTP Bank Nyrt			
508 508	HKD Alibaba Health Information Technology Ltd	276 117	0,04	12 885	HUF Richter Gedeon Nyrt	325 844	0,05
48 000	HKD Beijing Enterprises Holdings Ltd	166 894	0,03	Hongrie – Total			
328 000	HKD Beijing Enterprises Water Group Ltd	73 089	0,01			1 701 891	0,27
254 000	HKD Brilliance China Automotive Holdings Ltd	141 499	0,02	Inde			
69 872	HKD C&D International Investment Group Ltd	148 897	0,02	5 155	INR ABB India Ltd	289 602	0,05
341 296	HKD China Everbright Environment Group Ltd	111 018	0,02	16 189	INR Adani Enterprises Ltd	554 255	0,09
268 200	HKD China Gas Holdings Ltd	264 815	0,04	29 845	INR Adani Green Energy Ltd	572 771	0,09
127 268	HKD China Merchants Port Holdings Co Ltd	173 417	0,03	49 661	INR Adani Ports & Special Economic Zone Ltd	611 320	0,10
301 000	HKD China Overseas Land & Investment Ltd	530 413	0,08	72 592	INR Adani Power Ltd	458 118	0,07
120 000	HKD China Overseas Property Holdings Ltd	90 055	0,01	56 378	INR Ambuja Cements Ltd	352 914	0,06
442 000	HKD China Power International Development Ltd	162 455	0,03	14 088	INR APLApollo Tubes Ltd	260 179	0,04
128 257	HKD China Resources Beer Holdings Co Ltd	561 742	0,09	9 508	INR Apollo Hospitals Enterprise Ltd	651 750	0,10
86 900	HKD China Resources Gas Group Ltd	284 898	0,05	136 905	INR Ashok Leyland Ltd	298 690	0,05
269 111	HKD China Resources Land Ltd	964 982	0,15	33 656	INR Asian Paints Ltd	1 376 109	0,22
180 211	HKD China Resources Power Holdings Co Ltd	360 951	0,06	11 410	INR Astral Ltd	261 557	0,04
200 000	HKD China State Construction International Holdings Ltd	231 285	0,04	15 011	INR AU Small Finance Bank Ltd	142 040	0,02
142 898	HKD China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	122 977	0,02	24 745	INR Aurobindo Pharma Ltd	322 346	0,05
284 000	HKD China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	142 936	0,02	13 262	INR Avenue Supermarts Ltd	650 663	0,10
				205 690	INR Axis Bank Ltd	2 724 695	0,44
				6 351	INR Bajaj Auto Ltd	518 776	0,08
				24 505	INR Bajaj Finance Ltd	2 157 895	0,35
				35 950	INR Bajaj Finserv Ltd	728 299	0,12
				2 519	INR Bajaj Holdings & Investment Ltd	232 321	0,04
				7 679	INR Balkrishna Industries Ltd	237 027	0,04
				68 449	INR Bandhan Bank Ltd	198 568	0,03
				97 047	INR Bank of Baroda	269 517	0,04
				27 045	INR Berger Paints India Ltd	196 515	0,03
				293 256	INR Bharat Electronics Ltd	649 145	0,10
				24 214	INR Bharat Forge Ltd	360 342	0,06
				71 535	INR Bharat Petroleum Corp Ltd	387 403	0,06
				200 986	INR Bharti Airtel Ltd	2 493 071	0,40
				10 237	INR Britannia Industries Ltd	656 739	0,11

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Inde (suite)				Inde (suite)			
55 246	INR CG Power & Industrial Solutions Ltd	301 678	0,05	11 973	INR Maruti Suzuki India Ltd	1 482 328	0,24
38 500	INR Cholamandalam Investment and Finance Co Ltd	582 864	0,09	73 296	INR Max Healthcare Institute Ltd	604 460	0,10
42 682	INR Cipla Ltd	639 252	0,10	7 527	INR Mphasis Ltd	247 821	0,04
121 527	INR Coal India Ltd	549 118	0,09	187	INR MRF Ltd	291 194	0,05
11 652	INR Colgate-Palmolive India Ltd	354 221	0,06	11 968	INR Muthoot Finance Ltd	212 325	0,03
26 961	INR Container Corp Of India Ltd	278 524	0,04	2 815	INR Nestle India Ltd	899 173	0,14
12 960	INR Cummins India Ltd	305 872	0,05	381 192	INR NTPC Ltd	1 425 340	0,23
58 592	INR Dabur India Ltd	392 333	0,06	253 280	INR Oil & Natural Gas Corp Ltd	624 116	0,10
11 279	INR Divi's Laboratories Ltd	529 144	0,09	19 204	INR One 97 Communications Ltd	146 649	0,02
58 255	INR DLF Ltd	508 527	0,08	583	INR Page Industries Ltd	269 822	0,04
8 736	INR Dr Reddy's Laboratories Ltd	608 679	0,10	3 712	INR Persistent Systems Ltd	329 626	0,05
12 870	INR Eicher Motors Ltd	640 842	0,10	76 277	INR Petronet LNG Ltd	204 090	0,03
215 052	INR GAIL India Ltd	418 920	0,07	7 907	INR PI Industries Ltd	334 082	0,05
38 537	INR Godrej Consumer Products Ltd	523 868	0,08	14 496	INR Pidilite Industries Ltd	472 976	0,08
11 793	INR Godrej Properties Ltd	285 331	0,05	3 640	INR Polycab India Ltd	239 923	0,04
24 781	INR Grasim Industries Ltd	635 742	0,10	127 052	INR Power Finance Corp Ltd	584 159	0,09
23 682	INR Havells India Ltd	389 308	0,06	402 739	INR Power Grid Corp of India Ltd	1 148 004	0,18
82 164	INR HCL Technologies Ltd	1 447 605	0,23	111 422	INR REC Ltd	552 800	0,09
7 946	INR HDFC Asset Management Co Ltd	306 042	0,05	270 820	INR Reliance Industries Ltd	8 412 746	1,35
248 281	INR HDFC Bank Ltd	5 099 810	0,82	223 777	INR Samvardhana Motherson International Ltd	274 162	0,04
78 948	INR HDFC Life Insurance Co Ltd	613 548	0,10	26 535	INR SBI Cards & Payment Services Ltd	242 235	0,04
10 315	INR Hero MotoCorp Ltd	513 130	0,08	36 775	INR SBI Life Insurance Co Ltd	633 115	0,10
100 013	INR Hindalco Industries Ltd	738 976	0,12	851	INR Shree Cement Ltd	293 028	0,05
16 298	INR Hindustan Aeronautics Ltd	549 183	0,09	26 429	INR Shriram Finance Ltd	652 136	0,10
54 594	INR Hindustan Petroleum Corp Ltd	261 706	0,04	8 472	INR Siemens Ltd	409 755	0,07
72 383	INR Hindustan Unilever Ltd	2 317 221	0,37	38 750	INR Sona Blw Precision Forgings Ltd	300 123	0,05
458 307	INR ICICI Bank Ltd	5 488 862	0,88	14 078	INR SRF Ltd	419 436	0,07
22 672	INR ICICI Lombard General Insurance Co Ltd	386 913	0,06	152 825	INR State Bank of India	1 179 148	0,19
34 012	INR ICICI Prudential Life Insurance Co Ltd	218 609	0,04	81 870	INR Sun Pharmaceutical Industries Ltd	1 239 112	0,20
324 369	INR IDFC First Bank Ltd	346 534	0,06	5 983	INR Supreme Industries Ltd	326 634	0,05
80 758	INR Indian Hotels Co Ltd	425 414	0,07	823 033	INR Suzlon Energy Ltd	377 820	0,06
265 115	INR Indian Oil Corp Ltd	413 696	0,07	7 249	INR Tata Communications Ltd	154 216	0,03
22 157	INR Indian Railway Catering & Tourism Corp Ltd	236 311	0,04	81 292	INR Tata Consultancy Services Ltd	3 705 795	0,60
31 393	INR Indraprastha Gas Ltd	157 826	0,03	43 769	INR Tata Consumer Products Ltd	571 638	0,09
23 387	INR IndusInd Bank Ltd	449 381	0,07	3 219	INR Tata Elxsi Ltd	338 614	0,05
6 667	INR Info Edge India Ltd	411 824	0,07	139 214	INR Tata Motors Ltd	1 304 832	0,21
294 714	INR Infosys Ltd	5 464 412	0,88	54 305	INR Tata Motors Ltd	338 893	0,05
12 730	INR InterGlobe Aviation Ltd	453 906	0,07	110 748	INR Tata Power Co Ltd	442 054	0,07
258 167	INR ITC Ltd	1 433 645	0,23	625 011	INR Tata Steel Ltd	1 048 523	0,17
31 948	INR Jindal Steel & Power Ltd	287 216	0,05	43 820	INR Tech Mahindra Ltd	670 172	0,11
286 621	INR Jio Financial Services Ltd	802 372	0,13	30 468	INR Titan Co Ltd	1 345 734	0,22
56 518	INR JSW Steel Ltd	597 858	0,10	9 657	INR Torrent Pharmaceuticals Ltd	267 560	0,04
36 263	INR Jubilant Foodworks Ltd	246 238	0,04	17 072	INR Trent Ltd	626 749	0,10
98 338	INR Kotak Mahindra Bank Ltd	2 254 901	0,36	10 037	INR Tube Investments of India Ltd	427 183	0,07
19 140	INR Lupin Ltd	304 292	0,05	22 187	INR TVS Motor Co Ltd	540 132	0,09
20 350	INR Macrotech Developers Ltd	250 310	0,04	9 945	INR UltraTech Cement Ltd	1 255 235	0,20
82 481	INR Mahindra & Mahindra Ltd	1 714 172	0,28	27 452	INR United Spirits Ltd	368 743	0,06
48 843	INR Marico Ltd	321 947	0,05	44 116	INR UPL Ltd	311 332	0,05
				42 798	INR Varun Beverages Ltd	636 155	0,10
				68 530	INR Vedanta Ltd	212 927	0,03
				121 813	INR Wipro Ltd	689 916	0,11

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Inde (suite)				Corée (suite)			
1 218 434	INR Yes Bank Ltd	314 076	0,05	2 000	KRW HD Hyundai Heavy Industries Co Ltd	200 326	0,03
428 642	INR Zomato Ltd	637 191	0,10	3 977	KRW HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	373 336	0,06
Inde – Total		102 106 718	16,39	10 989	KRW HLB Inc	432 597	0,07
Indonésie				22 889	KRW HMM Co Ltd	347 982	0,06
1 365 500	IDR Adaro Energy Indonesia Tbk PT	211 073	0,03	2 844	KRW Hotel Shilla Co Ltd	144 419	0,02
573 800	IDR Amman Mineral Internasional PT	244 099	0,04	1 760	KRW HYBE Co Ltd	319 093	0,05
1 632 200	IDR Astra International Tbk PT	598 943	0,10	7 311	KRW Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	198 116	0,03
4 955 400	IDR Bank Central Asia Tbk PT	3 025 314	0,49	1 780	KRW Hyundai Glovis Co Ltd	264 671	0,04
3 248 900	IDR Bank Mandiri Persero Tbk PT	1 276 602	0,21	2 281	KRW Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd	150 366	0,02
1 397 200	IDR Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	487 754	0,08	5 199	KRW Hyundai Mobis Co Ltd	956 723	0,15
6 083 673	IDR Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	2 262 066	0,36	11 802	KRW Hyundai Motor Co	1 864 824	0,30
2 807 707	IDR Barito Pacific Tbk PT	242 531	0,04	3 852	KRW Hyundai Motor Co–Preferred Stock	341 563	0,05
692 300	IDR Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT	225 941	0,04	2 020	KRW Hyundai Motor Co–Preferred Stock	178 018	0,03
78 051 700	IDR GoTo Gojek Tokopedia Tbk PT	435 958	0,07	8 075	KRW Hyundai Steel Co	228 851	0,04
248 400	IDR Indah Kiat Pulp & Paper Tbk PT	134 307	0,02	12 279	KRW Industrial Bank of Korea	113 075	0,02
223 500	IDR Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	153 505	0,02	2 685	KRW JYP Entertainment Corp	211 189	0,03
438 500	IDR Indofood Sukses Makmur Tbk PT	183 693	0,03	26 937	KRW Kakao Corp	1 135 709	0,18
1 989 500	IDR Kalbe Farma Tbk PT	208 034	0,03	15 753	KRW KakaoBank Corp	348 599	0,06
463 816	IDR Merdeka Copper Gold Tbk PT	81 334	0,01	2 223	KRW Kakaopay Corp	85 095	0,01
1 919 600	IDR Sarana Menara Nusantara Tbk PT	123 427	0,02	9 606	KRW Kangwon Land Inc	119 338	0,02
329 879	IDR Semen Indonesia Persero Tbk PT	137 119	0,02	33 636	KRW KB Financial Group Inc	1 412 926	0,23
1 603 100	IDR Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT	305 065	0,05	23 130	KRW Kia Corp	1 795 947	0,29
4 265 300	IDR Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1 094 235	0,18	24 094	KRW Korea Electric Power Corp	353 581	0,06
759 300	IDR Unilever Indonesia Tbk PT	174 081	0,03	3 846	KRW Korea Investment Holdings Co Ltd	183 058	0,03
133 269	IDR United Tractors Tbk PT	195 831	0,03	791	KRW Korea Zinc Co Ltd	305 861	0,05
Indonésie – Total		11 800 912	1,90	16 578	KRW Korean Air Lines Co Ltd	307 644	0,05
Corée				2 730	KRW Krafton Inc	410 380	0,07
2 853	KRW Amorepacific Corp	321 209	0,05	6 266	KRW KT Corp	167 366	0,03
14 154	KRW Celltrion Inc	2 214 482	0,36	9 783	KRW KT&G Corp	660 100	0,11
1 785	KRW Celltrion Pharm Inc	127 787	0,02	2 902	KRW Kum Yang Co Ltd	246 058	0,04
741	KRW CJ CheilJedang Corp	186 415	0,03	1 636	KRW Kumho Petrochemical Co Ltd	168 821	0,03
2 359	KRW CosmoAM&T Co Ltd	269 804	0,04	2 391	KRW L&F Co Ltd	378 728	0,06
5 614	KRW Coway Co Ltd	249 337	0,04	4 388	KRW LG Chem Ltd	1 700 141	0,27
4 343	KRW DB Insurance Co Ltd	282 249	0,05	697	KRW LG Chem Ltd–Preferred Stock	168 310	0,03
5 421	KRW Doosan Bobcat Inc	212 143	0,03	8 921	KRW LG Corp	595 010	0,10
34 205	KRW Doosan Enerbility Co Ltd	422 284	0,07	21 755	KRW LG Display Co Ltd	215 202	0,03
4 203	KRW Ecopro BM Co Ltd	939 874	0,15	8 689	KRW LG Electronics Inc	686 808	0,11
1 669	KRW Ecopro Co Ltd	838 453	0,13	4 106	KRW LG Energy Solution Ltd	1 362 928	0,22
1 519	KRW F&F Co Ltd / New	105 206	0,02	862	KRW LG H&H Co Ltd	237 604	0,04
4 000	KRW GS Holdings Corp	127 028	0,02	1 344	KRW LG Innotek Co Ltd	249 932	0,04
24 818	KRW Hana Financial Group Inc	836 324	0,13	19 111	KRW LG Uplus Corp	151 802	0,02
7 210	KRW Hankook Tire & Technology Co Ltd	254 161	0,04	1 832	KRW Lotte Chemical Corp	217 923	0,03
671	KRW Hanmi Pharm Co Ltd	183 654	0,03	9 809	KRW Meritz Financial Group Inc	450 122	0,07
4 163	KRW Hanmi Semiconductor Co Ltd	199 439	0,03	24 843	KRW Mirae Asset Securities Co Ltd	147 179	0,02
17 812	KRW Hanon Systems	100 823	0,02	11 409	KRW Naver Corp	1 984 328	0,32
3 344	KRW Hanwha Aerospace Co Ltd	323 261	0,05	1 355	KRW NCSoft Corp	253 030	0,04
5 725	KRW Hanwha Ocean Co Ltd	111 575	0,02	2 926	KRW Netmarble Corp	131 998	0,02
10 031	KRW Hanwha Solutions Corp	307 652	0,05	2 247	KRW Orion Corp/Republic of Korea	202 560	0,03
4 033	KRW HD Hyundai Co Ltd	198 221	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				
Corée (suite)				Malaisie (suite)				
3 131	KRW Pearl Abyss Corp	94 205	0,02	311 000	MYR Dialog Group Bhd	140 102	0,02	
4 729	KRW Posco DX Co Ltd	263 273	0,04	171 207	MYR Gamuda Bhd	171 021	0,03	
2 551	KRW POSCO FUTURE M Co Ltd	711 087	0,11	201 900	MYR Genting Bhd	202 999	0,03	
6 467	KRW POSCO Holdings Inc	2 508 166	0,40	271 600	MYR Genting Malaysia Bhd	159 000	0,03	
4 834	KRW Posco International Corp	234 212	0,04	61 684	MYR Hong Leong Bank Bhd	253 717	0,04	
1 497	KRW Samsung Biologics Co Ltd	883 392	0,14	208 900	MYR IHH Healthcare Bhd	274 139	0,04	
6 956	KRW Samsung C&T Corp	699 435	0,11	238 500	MYR Inari Amertron Bhd	156 232	0,03	
4 434	KRW Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	527 439	0,08	236 100	MYR IOI Corp Bhd	201 931	0,03	
426 998	KRW Samsung Electronics Co Ltd	26 026 355	4,18	45 698	MYR Kuala Lumpur Kepong Bhd	217 003	0,04	
72 859	KRW Samsung Electronics Co Ltd–Preferred Stock	3 524 432	0,57	446 340	MYR Malayan Banking Bhd	863 539	0,14	
15 118	KRW Samsung Engineering Co Ltd	340 416	0,05	75 081	MYR Malaysia Airports Holdings Bhd	120 260	0,02	
2 907	KRW Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	593 634	0,10	212 000	MYR Maxis Bhd	177 628	0,03	
61 962	KRW Samsung Heavy Industries Co Ltd	372 859	0,06	133 000	MYR MISC Bhd	211 006	0,03	
7 557	KRW Samsung Life Insurance Co Ltd	405 457	0,07	280 900	MYR MR DIY Group M Bhd	88 641	0,01	
4 896	KRW Samsung SDI Co Ltd	1 794 326	0,29	6 700	MYR Nestle Malaysia Bhd	171 473	0,03	
3 690	KRW Samsung SDS Co Ltd	487 072	0,08	264 500	MYR Petronas Chemicals Group Bhd	412 148	0,07	
5 683	KRW Samsung Securities Co Ltd	169 885	0,03	29 200	MYR Petronas Dagangan Bhd	138 787	0,02	
36 739	KRW Shinhan Financial Group Co Ltd	1 145 330	0,18	73 300	MYR Petronas Gas Bhd	277 567	0,04	
3 015	KRW SK Biopharmaceuticals Co Ltd	235 038	0,04	59 440	MYR PPB Group Bhd	187 310	0,03	
2 535	KRW SK Bioscience Co Ltd	141 719	0,02	354 000	MYR Press Metal Aluminium Holdings Bhd	370 564	0,06	
48 657	KRW SK Hynix Inc	5 345 885	0,86	1 218 400	MYR Public Bank Bhd	1 137 527	0,18	
2 169	KRW SK IE Technology Co Ltd	132 878	0,02	102 150	MYR QL Resources Bhd	126 937	0,02	
3 471	KRW SK Inc	479 725	0,08	144 742	MYR RHB Bank Bhd	171 674	0,03	
5 620	KRW SK Innovation Co Ltd	612 226	0,10	279 834	MYR Sime Darby Bhd	143 114	0,02	
9 326	KRW SK Square Co Ltd	380 890	0,06	201 704	MYR Sime Darby Plantation Bhd	195 778	0,03	
2 415	KRW SK Telecom Co Ltd	93 945	0,01	105 359	MYR Telekom Malaysia Bhd	127 256	0,02	
1 766	KRW SKC Co Ltd	124 233	0,02	244 000	MYR Tenaga Nasional Bhd	533 136	0,09	
4 291	KRW S-Oil Corp	231 892	0,04	Malaisie – Total			8 462 992	1,36
47 499	KRW Woori Financial Group Inc	479 453	0,08	Mexique				
5 341	KRW Yuhan Corp	285 318	0,05	291 600	MXN Alfa SAB de CV	234 871	0,04	
Corée – Total				1 653 900	MXN America Movil SAB de CV	1 537 240	0,25	
				40 450	MXN Arca Continental SAB de CV	442 873	0,07	
				71 400	MXN Banco del Bajío SA	239 483	0,04	
Koweït				1 300 387	MXN Cemex SAB de CV	1 015 153	0,16	
150 877	KWD Agility Public Warehousing Co KSC	249 948	0,04	49 660	MXN Coca-Cola Femsa SAB de CV	472 041	0,08	
131 599	KWD Boubyan Bank KSCP	256 987	0,04	271 900	MXN Fibra Uno Administracion SA de CV REIT	490 831	0,08	
175 571	KWD Gulf Bank KSCP	160 571	0,03	172 700	MXN Fomento Economico Mexicano SAB de CV	2 253 784	0,36	
765 724	KWD Kuwait Finance House KSCP	1 809 327	0,29	17 780	MXN Gruma SAB de CV	326 674	0,05	
62 488	KWD Mabane Co KPSC	171 448	0,03	17 000	MXN Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	180 455	0,03	
181 551	KWD Mobile Telecommunications Co KSCP	299 581	0,05	37 000	MXN Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	647 667	0,10	
711 025	KWD National Bank of Kuwait SAKP	2 068 857	0,33	14 780	MXN Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV	434 170	0,07	
Koweït – Total				106 000	MXN Grupo Bimbo SAB de CV	537 996	0,09	
				52 964	MXN Grupo Carso SAB de CV	592 958	0,09	
Luxembourg				233 873	MXN Grupo Financiero Banorte SAB de CV	2 358 272	0,38	
12 636	ZAR Reinet Investments SCA	322 134	0,05	173 300	MXN Grupo Financiero Inbursa SAB de CV	478 009	0,08	
Luxembourg – Total				273 100	MXN Grupo Mexico SAB de CV	1 518 826	0,24	
Malaisie								
167 900	MYR AMMB Holdings Bhd	146 524	0,02					
276 086	MYR Axiata Group Bhd	143 000	0,02					
328 000	MYR CELCOMDIGI Bhd	291 238	0,05					
511 923	MYR CIMB Group Holdings Bhd	651 741	0,11					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Mexique (suite)				Pologne (suite)			
18 710	MXN Industrias Penoles SAB de CV	274 267	0,04	56 539	PLN Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	679 661	0,11
144 400	MXN Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	325 475	0,05	3 386	PLN Santander Bank Polska SA	421 759	0,07
122 600	MXN Operadora De Sites Mexicanos SAB de CV	173 317	0,03	Pologne – Total			
99 137	MXN Orbia Advance Corp SAB de CV	220 233	0,04	6 084 647			
64 800	MXN Prologis Property Mexico SA de CV REIT	308 991	0,05	0,98			
16 695	MXN Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	181 122	0,03	Qatar			
464 300	MXN Wal-Mart de Mexico SAB de CV	1 962 263	0,31	215 942	QAR Barwa Real Estate Co	170 868	0,03
Mexique – Total				303 245	QAR Commercial Bank PSQC	495 553	0,08
17 206 971				172 069	QAR Dukhan Bank	188 893	0,03
2,76				142 460	QAR Industries Qatar QSC	504 733	0,08
Pays-Bas				524 298	QAR Masraf Al Rayan QSC	373 244	0,06
45 078	ZAR NEPI Rockcastle NV	311 522	0,05	429 800	QAR Mesaieed Petrochemical Holding Co	208 939	0,03
Pays-Bas – Total				70 372	QAR Ooredoo QPSC	210 671	0,03
311 522				41 499	QAR Qatar Electricity & Water Co QSC	206 070	0,03
Pérou				55 965	QAR Qatar Fuel QSC	251 312	0,04
20 146	USD Cia de Minas Buenaventura SAA-ADR	307 025	0,05	241 855	QAR Qatar Gas Transport Co Ltd	229 832	0,04
6 373	USD Credicorp Ltd	955 504	0,15	94 469	QAR Qatar International Islamic Bank QSC	273 470	0,05
Pérou – Total				155 449	QAR Qatar Islamic Bank SAQ	892 305	0,14
1 262 529				434 421	QAR Qatar National Bank QPSC	1 914 984	0,31
Philippines				Qatar – Total			
149 970	PHP Aboitiz Equity Ventures Inc	120 789	0,02	5 920 874			
23 466	PHP Ayala Corp	288 584	0,05	Russie			
644 510	PHP Ayala Land Inc	400 964	0,06	609 155	RUB Gazprom PJSC*	0	0,00
187 834	PHP Bank of the Philippine Islands	352 093	0,06	2 086 320	RUB Inter RAO UES PJSC*	0	0,00
223 162	PHP BDO Unibank Inc	525 917	0,08	21 289	RUB LUKOIL PJSC*	0	0,00
95 420	PHP International Container Terminal Services Inc	425 276	0,07	22 838	USD Mobile TeleSystems PJSC-ADR*	0	0,00
248 751	PHP JG Summit Holdings Inc	171 374	0,03	2 585	USD Ozon Holdings PLC*	0	0,00
39 850	PHP Jollibee Foods Corp	180 917	0,03	1 100	RUB United Co RUSAL International PJSC*	0	0,00
25 730	PHP Manila Electric Co	185 396	0,03	2 000	USD VK IPJSC*	0	0,00
169 155	PHP Metropolitan Bank & Trust Co	156 707	0,02	6 010	USD X5 Retail Group NV-GDR*	0	0,00
7 170	PHP PLDT Inc	165 606	0,03	Russie – Total			
23 142	PHP SM Investments Corp	364 421	0,06	0			
955 050	PHP SM Prime Holdings Inc	567 425	0,09	Arabie saoudite			
83 950	PHP Universal Robina Corp	179 194	0,03	7 436	SAR ACWA Power Co	509 614	0,08
Philippines – Total				175 740	SAR Al Rajhi Bank	4 077 168	0,65
4 084 663				82 169	SAR Alinma Bank	849 080	0,14
Pologne				23 392	SAR Almarai Co JSC	350 568	0,06
44 615	PLN Allegro.eu SA	378 103	0,06	63 411	SAR Arab National Bank	428 658	0,07
17 218	PLN Bank Polska Kasa Opieki SA	665 776	0,11	2 368	SAR Arabian Internet & Communications Services Co	218 614	0,04
1 181	PLN Budimex SA	188 011	0,03	46 010	SAR Bank AlBilad	551 507	0,09
6 529	PLN CD Projekt SA	190 943	0,03	39 132	SAR Bank Al-Jazira	195 138	0,03
24 623	PLN Cyfrowy Polsat SA	77 208	0,01	45 845	SAR Banque Saudi Fransi	489 013	0,08
4 603	PLN Dino Polska SA	539 285	0,09	7 201	SAR Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co	409 401	0,07
13 011	PLN KGHM Polska Miedz SA	405 989	0,06	6 954	SAR Co for Cooperative Insurance	241 814	0,04
105	PLN LPP SA	432 310	0,07	3 207	SAR Dallah Healthcare Co	146 752	0,02
1 380	PLN mBank SA	187 755	0,03	50 731	SAR Dar Al Arkan Real Estate Development Co	188 314	0,03
48 193	PLN ORLEN SA	802 757	0,13	6 882	SAR Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	520 830	0,08
86 437	PLN PGE Polska Grupa Energetyczna SA	190 756	0,03	2 247	SAR Elm Co	488 348	0,08
72 232	PLN Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	924 334	0,15	35 285	SAR Etihad Etisalat Co	464 821	0,07

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				
Arabie saoudite (suite)				Afrique du Sud (suite)				
55 456 SAR	Jarir Marketing Co	231 289	0,04	79 184 ZAR	OUTsurance Group Ltd	182 724	0,03	
43 256 SAR	Mobile Telecommunications Co Saudi Arabia	162 873	0,03	192 106 ZAR	Pepkor Holdings Ltd	206 209	0,03	
9 208 SAR	Mouwasat Medical Services Co	274 521	0,04	49 862 ZAR	Remgro Ltd	443 012	0,07	
4 010 SAR	Nahdi Medical Co	146 499	0,02	166 093 ZAR	Sanlam Ltd	661 193	0,11	
31 144 SAR	National Industrialization Co	102 152	0,02	53 891 ZAR	Sasol Ltd	546 027	0,09	
7 065 SAR	Power & Water Utility Co for Jubail & Yanbu	118 127	0,02	40 487 ZAR	Shoprite Holdings Ltd	608 938	0,10	
39 293 SAR	Rabigh Refining & Petrochemical Co	109 182	0,02	266 858 ZAR	Sibanye Stillwater Ltd	363 350	0,06	
125 073 SAR	Riyad Bank	952 223	0,15	113 730 ZAR	Standard Bank Group Ltd	1 294 174	0,21	
19 266 SAR	SABIC Agri-Nutrients Co	710 016	0,11	58 937 ZAR	Vodacom Group Ltd	341 617	0,05	
33 929 SAR	Sahara International Petrochemical Co	308 075	0,05	88 651 ZAR	Woolworths Holdings Ltd	349 999	0,06	
112 084 SAR	Saudi Arabian Mining Co	1 319 602	0,21	Afrique du Sud – Total			18 072 434	2,90
238 696 SAR	Saudi Arabian Oil Co	2 103 707	0,34	Taiwan				
4 795 SAR	Saudi Aramco Base Oil Co	181 059	0,03	47 000 TWD	Accton Technology Corp	800 932	0,13	
83 979 SAR	Saudi Awwal Bank	842 029	0,14	271 000 TWD	Acer Inc	475 059	0,08	
77 327 SAR	Saudi Basic Industries Corp	1 717 690	0,28	43 909 TWD	Advantech Co Ltd	532 222	0,09	
77 330 SAR	Saudi Electricity Co	390 981	0,06	13 510 TWD	Airtac International Group	444 603	0,07	
34 597 SAR	Saudi Industrial Investment Group	204 814	0,03	263 483 TWD	ASE Technology Holding Co Ltd	1 158 997	0,19	
47 131 SAR	Saudi Investment Bank	199 835	0,03	220 000 TWD	Asia Cement Corp	297 128	0,05	
70 582 SAR	Saudi Kayan Petrochemical Co	204 406	0,03	58 000 TWD	Asustek Computer Inc	925 075	0,15	
263 821 SAR	Saudi National Bank	2 722 633	0,44	613 600 TWD	AUO Corp	362 876	0,06	
3 159 SAR	Saudi Research & Media Group	143 882	0,02	54 000 TWD	Catcher Technology Co Ltd	341 343	0,05	
4 439 SAR	Saudi Tadawul Group Holding Co	217 333	0,03	826 229 TWD	Cathay Financial Holding Co Ltd	1 231 651	0,20	
176 193 SAR	Saudi Telecom Co	1 900 535	0,31	126 953 TWD	Chailease Holding Co Ltd	798 355	0,13	
25 429 SAR	Savola Group	253 273	0,04	514 098 TWD	Chang Hwa Commercial Bank Ltd	299 844	0,05	
27 236 SAR	Yanbu National Petrochemical Co	275 992	0,04	184 000 TWD	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	269 191	0,04	
Arabie saoudite – Total				279 000 TWD	China Airlines Ltd	196 815	0,03	
25 922 368				1 256 445 TWD	China Development Financial Holding Corp	513 787	0,08	
4,16				1 110 000 TWD	China Steel Corp	976 524	0,16	
Singapour				333 000 TWD	Chunghwa Telecom Co Ltd	1 302 032	0,21	
18 800 HKD	BOC Aviation Ltd	143 735	0,02	393 000 TWD	Compal Electronics Inc	510 290	0,08	
Singapour – Total				1 515 360 TWD	CTBC Financial Holding Co Ltd	1 399 797	0,22	
143 735				183 152 TWD	Delta Electronics Inc	1 870 877	0,30	
0,02				81 000 TWD	E Ink Holdings Inc	519 933	0,08	
Afrique du Sud				1 204 911 TWD	E.Sun Financial Holding Co Ltd	1 012 910	0,16	
68 495 ZAR	Absa Group Ltd	613 168	0,10	17 169 TWD	Eclat Textile Co Ltd	314 396	0,05	
6 264 ZAR	Anglo American Platinum Ltd	330 198	0,05	6 000 TWD	eMemory Technology Inc	478 976	0,08	
35 824 ZAR	Aspen Pharmacare Holdings Ltd	398 643	0,06	255 000 TWD	Eva Airways Corp	261 311	0,04	
31 546 ZAR	Bid Corp Ltd	735 973	0,12	95 264 TWD	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	445 427	0,07	
27 330 ZAR	Bidvest Group Ltd	377 038	0,06	282 000 TWD	Far Eastern New Century Corp	286 682	0,05	
8 216 ZAR	Capitec Bank Holdings Ltd	910 380	0,15	151 000 TWD	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	392 623	0,06	
23 008 ZAR	Clicks Group Ltd	409 785	0,07	47 208 TWD	Feng TAY Enterprise Co Ltd	269 184	0,04	
50 747 ZAR	Discovery Ltd	398 706	0,06	1 027 746 TWD	First Financial Holding Co Ltd	917 556	0,15	
23 226 ZAR	Exxaro Resources Ltd	259 699	0,04	333 000 TWD	Formosa Chemicals & Fibre Corp	675 971	0,11	
431 304 ZAR	FirstRand Ltd	1 733 706	0,28	75 000 TWD	Formosa Petrochemical Corp	197 211	0,03	
78 155 ZAR	Gold Fields Ltd	1 187 144	0,19	304 000 TWD	Formosa Plastics Corp	784 503	0,13	
50 001 ZAR	Harmony Gold Mining Co Ltd	326 978	0,05	683 213 TWD	Fubon Financial Holding Co Ltd	1 442 538	0,23	
81 681 ZAR	Impala Platinum Holdings Ltd	407 657	0,06	48 000 TWD	Gigabyte Technology Co Ltd	416 025	0,07	
6 064 ZAR	Kumba Iron Ore Ltd	203 856	0,03	8 000 TWD	Global Unichip Corp	453 561	0,07	
143 835 ZAR	MTN Group Ltd	908 432	0,15	20 000 TWD	Globalwafers Co Ltd	382 529	0,06	
16 336 ZAR	Naspers Ltd	2 794 204	0,45					
41 662 ZAR	Nedbank Group Ltd	492 608	0,08					
33 668 ZAR	Northam Platinum Holdings Ltd	258 537	0,04					
459 958 ZAR	Old Mutual Ltd	328 479	0,05					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Taïwan (suite)				Taïwan (suite)			
1 090 000	TWD Hon Hai Precision Industry Co Ltd	3 711 409	0,60	147 640	TWD WPG Holdings Ltd	392 546	0,06
28 480	TWD Hotai Motor Co Ltd	657 934	0,11	31 521	TWD Yageo Corp	613 155	0,10
837 288	TWD Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	609 745	0,10	167 000	TWD Yang Ming Marine Transport Corp	279 145	0,04
827 434	TWD Innolux Corp	385 536	0,06	953 691	TWD Yuanta Financial Holding Co Ltd	857 655	0,14
253 000	TWD Inventec Corp	435 262	0,07	62 000	TWD Zhen Ding Technology Holding Ltd	220 198	0,04
8 500	TWD Largan Precision Co Ltd	794 871	0,13	Taiwan – Total			
162 219	TWD Lite-On Technology Corp	618 420	0,10	99 512 839			
136 000	TWD MediaTek Inc	4 497 809	0,72	15,98			
961 484	TWD Mega Financial Holding Co Ltd	1 228 073	0,20	Thaïlande			
52 000	TWD Micro-Star International Co Ltd	345 644	0,06	83 614	THB Advanced Info Service PCL	531 582	0,09
9 040	TWD momo.com Inc	149 928	0,02	12 012	THB Advanced Info Service PCL–NVDR	76 367	0,01
383 000	TWD Nan Ya Plastics Corp	829 882	0,13	213 379	THB Airports of Thailand PCL	373 527	0,06
21 000	TWD Nan Ya Printed Circuit Board Corp	172 089	0,03	129 036	THB Airports of Thailand PCL–NVDR	225 882	0,04
111 000	TWD Nanya Technology Corp	282 107	0,05	543 301	THB Bangkok Dusit Medical Services PCL	441 708	0,07
17 000	TWD Nien Made Enterprise Co Ltd	195 533	0,03	370 099	THB Bangkok Dusit Medical Services PCL–NVDR	300 893	0,05
48 000	TWD Novatek Microelectronics Corp	808 589	0,13	252 275	THB Bangkok Expressway & Metro PCL	58 759	0,01
7 000	TWD Parade Technologies Ltd	273 700	0,04	451 283	THB Bangkok Expressway & Metro PCL–NVDR	105 111	0,02
187 000	TWD Pegatron Corp	531 927	0,09	683 400	THB Banpu PCL–NVDR	136 149	0,02
23 000	TWD PharmaEssentia Corp	259 298	0,04	729 904	THB BTS Group Holdings PCL–NVDR	155 037	0,02
210 000	TWD Pou Chen Corp	211 434	0,03	34 999	THB Bumrungrad Hospital PCL	227 636	0,04
271 000	TWD Powerchip Semiconductor Manufacturing Corp	260 046	0,04	21 100	THB Bumrungrad Hospital PCL	137 236	0,02
54 000	TWD President Chain Store Corp	474 186	0,08	68 014	THB Central Pattana PCL	139 485	0,02
239 000	TWD Quanta Computer Inc	1 748 277	0,28	117 554	THB Central Pattana PCL–NVDR	241 083	0,04
39 000	TWD Realtek Semiconductor Corp	599 159	0,10	66 896	THB Central Retail Corp PCL	80 356	0,01
148 895	TWD Ruentex Development Co Ltd	183 144	0,03	101 900	THB Central Retail Corp PCL–NVDR	122 402	0,02
296 293	TWD Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	451 818	0,07	359 945	THB Charoen Pokphand Foods PCL–NVDR	206 692	0,03
1 262 477	TWD Shin Kong Financial Holding Co Ltd	364 051	0,06	410 672	THB CP ALL PCL	673 775	0,11
991 382	TWD SinoPac Financial Holdings Co Ltd	636 361	0,10	71 717	THB CP ALL PCL–NVDR	117 664	0,02
116 350	TWD Synnex Technology International Corp	266 134	0,04	203 000	THB CP Axtra PCL–NVDR	160 580	0,03
1 055 048	TWD Taishin Financial Holding Co Ltd	622 224	0,10	293 390	THB Delta Electronics Thailand PCL	756 415	0,12
579 664	TWD Taiwan Business Bank	258 757	0,04	7 552	THB Energy Absolute PCL	9 791	0,00
609 232	TWD Taiwan Cement Corp	691 802	0,11	148 900	THB Energy Absolute PCL–NVDR	193 037	0,03
854 433	TWD Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	743 336	0,12	73 800	THB Global Power Synergy PCL–NVDR	104 865	0,02
179 000	TWD Taiwan High Speed Rail Corp	179 055	0,03	275 170	THB Gulf Energy Development PCL	358 751	0,06
163 000	TWD Taiwan Mobile Co Ltd	523 673	0,08	527 725	THB Home Product Center PCL	180 895	0,03
2 196 000	TWD Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	42 430 980	6,81	65 600	THB Indorama Ventures PCL	52 372	0,01
112 000	TWD Unimicron Technology Corp	642 283	0,10	93 872	THB Indorama Ventures PCL–NVDR	74 944	0,01
394 000	TWD Uni-President Enterprises Corp	956 420	0,15	89 555	THB Intouch Holdings PCL–NVDR	187 598	0,03
995 000	TWD United Microelectronics Corp	1 705 316	0,27	54 900	THB Kasikornbank PCL	217 139	0,03
84 000	TWD Vanguard International Semiconductor Corp	223 066	0,04	325 100	THB Krung Thai Bank PCL	175 253	0,03
6 000	TWD Voltronic Power Technology Corp	334 305	0,05	105 863	THB Krungthai Card PCL	134 917	0,02
267 211	TWD Walsin Lihwa Corp	336 511	0,05	622 297	THB Land & Houses PCL	148 589	0,02
68 410	TWD Wan Hai Lines Ltd	122 597	0,02	182 300	THB Land & Houses PCL–NVDR	43 529	0,01
287 366	TWD Winbond Electronics Corp	285 114	0,05	92 455	THB Minor International PCL	79 907	0,01
211 000	TWD Wistron Corp	677 884	0,11	218 302	THB Minor International PCL–NVDR	188 674	0,03
8 000	TWD Wiyynn Corp	475 717	0,08	62 932	THB Muangthai Capital PCL	82 969	0,01
				153 800	THB Osotspa PCL–NVDR	99 131	0,02
				121 791	THB PTT Exploration & Production PCL	532 658	0,08

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,23 % (suite)			
Thaïlande (suite)				Royaume-Uni			
32 052	THB PTT Global Chemical PCL	36 153	0,01	39 518	ZAR AngloGold Ashanti Plc	763 694	0,12
179 597	THB PTT Global Chemical PCL–NVDR	202 578	0,03	18 935	PLN Pepco Group NV	125 487	0,02
276 118	THB PTT Oil & Retail Business PCL	154 511	0,02	Royaume-Uni – Total			
495 502	THB PTT PCL	518 983	0,08	889 181 0,14			
403 829	THB PTT PCL–NVDR	422 966	0,07	États-Unis			
78 920	THB SCB X PCL	243 368	0,04	58 000	HKD BeiGene Ltd	817 796	0,13
130 605	THB SCG Packaging PCL	137 751	0,02	5 900	USD Legend Biotech Corp	355 003	0,06
73 213	THB Siam Cement PCL–NVDR	656 359	0,11	8 000	USD Southern Copper Corp	688 560	0,11
9 481	THB Thai Oil PCL	14 930	0,00	36 700	USD Yum China Holdings Inc	1 557 181	0,25
101 020	THB Thai Oil PCL–NVDR	159 081	0,03	États-Unis – Total			
2 241 200	THB TMBThanachart Bank PCL–NVDR	109 655	0,02	3 418 540 0,55			
922 094	THB True Corp PCL	136 426	0,02	Total des actions ordinaires et préférentielles			
Thaïlande – Total				618 130 406 99,23			
10 926 119 1,75				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
Turquie				Autres valeurs mobilières			
294 711	TRY Akbank TAS	364 422	0,06	Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 %			
132 784	TRY Aselsan Elektronik Sanayi Ve Ticaret AS	202 229	0,03	Hong Kong			
42 796	TRY BIM Birlesik Magazalar AS	435 799	0,07	283 900	HKD China Common Rich Renewable Energy Investments Ltd*	0	0,00
127 703	TRY Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	177 281	0,03	84 000	HKD China Huishan Dairy Holdings Co Ltd*	0	0,00
6 765	TRY Ford Otomotiv Sanayi AS	169 388	0,03	Hong-Kong – Total			
95 976	TRY Haci Omer Sabanci Holding AS	196 443	0,03	0 0,00			
100 584	TRY Hektas Ticaret TAS	68 455	0,01	Russie			
71 498	TRY KOC Holding AS	343 279	0,06	145 730	RUB Alrosa PJSC*	0	0,00
99 532	TRY Koza Altin Isletmeleri AS	65 818	0,01	93 068	RUB Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC*	0	0,00
3 832	TRY Pegasus Hava Tasimaciligi AS	84 272	0,01	46 580	RUB Novatek PJSC*	0	0,00
101 204	TRY Sasa Polyester Sanayi AS	124 869	0,02	94 247	RUB Novolipetsk Steel PJSC*	0	0,00
12 054	TRY Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	85 709	0,01	2 174	RUB PhosAgro PJSC*	0	0,00
51 987	TRY Turk Hava Yollari AO	402 391	0,07	2	USD PhosAgro PJSC–GDR*	0	0,00
113 640	TRY Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	215 860	0,04	42	USD PHOSAGRO PJSC*	0	0,00
328 993	TRY Turkiye Is Bankasi AS	260 218	0,04	1 674	RUB Polyus PJSC*	0	0,00
90 747	TRY Turkiye Petrol Rafinerileri AS	439 386	0,07	66 565	RUB Rosneft Oil Co PJSC*	0	0,00
130 271	TRY Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS	202 107	0,03	552 724	RUB Sberbank of Russia PJSC*	0	0,00
318 247	TRY Yapi ve Kredi Bankasi AS	210 556	0,03	10 464	RUB Severstal PAO*	0	0,00
Turquie – Total				573 495 RUB Surgutneftegas PJSC*			
4 048 482 0,65				71 818 RUB Tatneft PJSC*			
Émirats arabes unis				222 152 814 RUB VTB Bank PJSC*			
230 481	AED Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	576 085	0,09	15 564	RUB Yandex NV*	0	0,00
104 201	AED Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	287 118	0,05	Russie – Total			
296 744	AED Abu Dhabi National Oil Co for Distribution PJSC	298 946	0,05	0 0,00			
294 060	AED Aldar Properties PJSC	428 350	0,07	Taiwan			
239 004	AED Americana Restaurants International PLC	203 685	0,03	22 045	TWD Mega Financial Holding Co Ltd	4 454	0,00
271 487	AED Dubai Islamic Bank PJSC	422 818	0,07	Taiwan – Total			
575 160	AED Emaar Properties PJSC	1 240 288	0,20	4 454 0,00			
156 238	AED Emirates NBD Bank PJSC	735 938	0,12	Total des actions ordinaires et préférentielles			
308 032	AED Emirates Telecommunications Group Co PJSC	1 647 198	0,26	4 454 0,00			
388 699	AED First Abu Dhabi Bank PJSC	1 477 432	0,24	Total des autres valeurs mobilières			
369 999	AED Multiply Group PJSC	320 358	0,05	4 454 0,00			
Émirats arabes unis – Total				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
7 638 216 1,23				618 134 860 99,23			

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,02 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	90	4 651 650	83 405	0,02
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			4 651 650	83 405	0,02
Total des contrats à terme standardisés			4 651 650	83 405	0,02
Autres actifs/(passifs) nets				4 697 510	0,75
TOTAL DES ACTIFS NETS				622 915 775	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 53 474 USD détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

* Le Conseil d'administration a décidé de fixer le prix du titre à 0,00 conformément aux procédures d'évaluation des investissements en vigueur.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Obligations d'entreprise – 12,26 %				Obligations d'entreprise – 12,26 % (<i>suite</i>)			
Australie				France (<i>suite</i>)			
100 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 2.125%, 24/05/28	96 563	0,05	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.375%, 13/01/29	103 532	0,05
Australie – Total				100 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.875%, 11/07/30	86 190	0,04
Belgique				100 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.750%, 13/11/32	106 091	0,05
295 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.125%, 02/12/27	287 298	0,15	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.250%, perpetual	103 415	0,05
100 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.875%, 02/04/32	98 934	0,05	100 000 EUR	Bouygues SA, 1.125%, 24/07/28	93 184	0,05
100 000 EUR	KBC Group NV, 4.375%, perpetual	103 801	0,05	100 000 EUR	Bouygues SA, 4.625%, 07/06/32	109 857	0,06
Belgique – Total				100 000 EUR	BPCE SA, 3.500%, 25/01/28	101 104	0,05
Canada				200 000 EUR	BPCE SA, 4.375%, 13/07/28	206 752	0,11
2 000 000 EUR	Canadian Imperial Bank of Commerce, 1.000%, 05/04/24	2 000 040	1,02	100 000 EUR	BPCE SA, 1.000%, 05/10/28	91 385	0,05
100 000 EUR	Royal Bank of Canada, 2.125%, 26/04/29	94 232	0,05	100 000 EUR	BPCE SA, 0.250%, 14/01/31	80 510	0,04
100 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 1.952%, 08/04/30	91 795	0,05	100 000 EUR	Capgemini SE, 2.000%, 15/04/29	95 693	0,05
100 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 3.129%, 03/08/32	97 806	0,05	100 000 EUR	Carrefour SA, 2.625%, 15/12/27	98 081	0,05
Canada – Total				100 000 EUR	Cie de Saint-Gobain SA, 1.875%, 15/03/31	92 292	0,05
Danemark				100 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.375%, 28/07/27	100 700	0,05
100 000 EUR	Danske Bank A/S, 4.125%, 10/01/31	103 604	0,05	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.125%, 09/12/27	88 722	0,05
Danemark – Total				200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.375%, 20/04/28	176 694	0,09
Finlande				100 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.875%, 14/01/32	82 248	0,04
100 000 EUR	Nordea Bank Abp, 1.125%, 27/09/27	94 405	0,05	100 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.875%, perpetual	103 350	0,05
100 000 EUR	Nordea Bank Abp, 4.125%, 05/05/28	103 235	0,05	100 000 EUR	Danone SA, 1.208%, 03/11/28	93 173	0,05
100 000 EUR	Nordea Bank Abp, 2.500%, 23/05/29	96 173	0,05	100 000 EUR	Engie SA, 3.625%, 11/01/30	102 699	0,05
Finlande – Total				100 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.375%, 27/11/27	91 466	0,05
France				100 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.500%, 05/06/28	91 222	0,05
100 000 EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.250%, 18/01/27	95 415	0,05	100 000 EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.100%, 03/09/27	89 728	0,05
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.250%, 26/05/27	93 797	0,05	100 000 EUR	L'Oreal SA, 2.875%, 19/05/28	100 506	0,05
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3.875%, 26/01/28	101 475	0,05	100 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.375%, 11/02/31	85 348	0,04
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.125%, 13/03/29	103 804	0,05	100 000 EUR	Orange SA, 2.000%, 15/01/29	96 074	0,05
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 2.625%, 06/11/29	95 022	0,05	200 000 EUR	Orange SA, 0.500%, 04/09/32	163 180	0,08
200 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.750%, 17/01/30	169 284	0,09	100 000 EUR	Sanofi SA, 1.375%, 21/03/30	92 350	0,05
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4.750%, 10/11/31	106 139	0,05	100 000 EUR	Sanofi SA, 1.500%, 01/04/30	92 949	0,05
100 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.125%, 19/01/32	83 349	0,04	100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.750%, 25/01/27	91 974	0,05
300 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.500%, 23/05/28	281 196	0,14	100 000 EUR	Societe Generale SA, 4.125%, 02/06/27	102 584	0,05
200 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.500%, 25/05/28	189 310	0,10	100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.250%, 08/07/27	90 028	0,05
100 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.750%, 25/07/28	97 376	0,05	100 000 EUR	Societe Generale SA, 2.125%, 27/09/28	94 474	0,05
				100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.500%, 12/06/29	104 208	0,05
				100 000 EUR	Societe Generale SA, 4.750%, 28/09/29	86 721	0,04

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 12,26 % (suite)				Obligations d'entreprise – 12,26 % (suite)				
France (suite)				Japon				
100 000 EUR	Societe Generale SA, 4.875%, 21/11/31	104 582	0,05	100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.693%, 07/10/30	83 276	0,04	
100 000 EUR	Societe Generale SA, 4.250%, 16/11/32	106 327	0,05	100 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.342%, 03/03/30	86 035	0,05	
200 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 0.750%, 12/07/28	182 744	0,09	100 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0.632%, 23/10/29	85 559	0,04	
100 000 EUR	TotalEnergies Capital International SA, 1.994%, 08/04/32	92 574	0,05	100 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 3.000%, 21/11/30	98 631	0,05	
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0.625%, 04/05/27	91 447	0,05	Japon – Total			353 501	0,18
100 000 EUR	Vinci SA, 1.750%, 26/09/30	92 938	0,05	Luxembourg				
France – Total				100 000 EUR	Aroundtown SA, 0.375%, 15/04/27	80 375	0,04	
		5 675 263	2,90	100 000 EUR	CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 1.125%, 17/10/28	90 172	0,05	
Allemagne				100 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.750%, 18/09/31	84 285	0,04	
100 000 EUR	BASF SE, 1.500%, 17/03/31	90 075	0,05	100 000 EUR	Grand City Properties SA, 0.125%, 11/01/28	83 919	0,04	
200 000 EUR	Deutsche Bank AG, 5.000%, 05/09/30	206 576	0,10	100 000 EUR	Holcim Finance Luxembourg SA, 0.500%, 03/09/30	83 030	0,04	
100 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.750%, 19/11/30	86 903	0,04	150 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.125%, 07/03/27	141 787	0,07	
100 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 1.750%, 25/03/31	93 949	0,05	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.000%, 02/07/31	86 442	0,04	
40 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.000%, 15/11/27	37 411	0,02	100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.750%, 15/10/32	82 386	0,04	
47 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.375%, 11/05/28	44 353	0,02	80 000 EUR	Nestle Finance International Ltd, 1.500%, 01/04/30	74 365	0,04	
160 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.500%, 03/07/29	149 675	0,08	100 000 EUR	Novartis Finance SA, 0.010%, 23/09/28	88 472	0,05	
100 000 EUR	Robert Bosch GmbH, 3.625%, perpetual	102 623	0,05	100 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.500%, 26/03/30	92 490	0,05	
100 000 EUR	SAP SE, 1.625%, 10/03/31	93 287	0,05	100 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 0.750%, 24/03/29	86 947	0,05	
50 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.125%, 12/02/27	45 399	0,02	Luxembourg – Total			1 074 670	0,55
60 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.875%, 31/01/28	54 290	0,03	Pays-Bas				
100 000 EUR	Vonovia SE, 0.250%, 01/09/28	84 908	0,04	100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.875%, 21/12/26	102 037	0,05	
100 000 EUR	Vonovia SE, 0.750%, 01/09/32	75 985	0,04	100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.000%, 16/01/28	102 548	0,05	
Allemagne – Total				100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.375%, 20/10/28	103 692	0,05	
		1 165 434	0,59	70 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.375%, 03/02/27	66 556	0,03	
Italie				100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 4.625%, 27/01/28	103 546	0,05	
100 000 EUR	ASTM SpA, 1.500%, 25/01/30	86 947	0,04	100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.875%, 05/05/28	92 177	0,05	
100 000 EUR	Autostrade per l'Italia SpA, 2.000%, 15/01/30	88 593	0,05	100 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 1.125%, 07/05/31	85 890	0,04	
120 000 EUR	Eni SpA, 0.625%, 23/01/30	103 325	0,05	100 000 EUR	Easyjet Finco Bv, 1.875%, perpetual	93 468	0,05	
100 000 EUR	Eni SpA, 2.000%, 18/05/31	91 721	0,05	100 000 EUR	Edp Finance BV, 1.875%, 21/09/29	93 385	0,05	
200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.750%, 16/03/28	180 156	0,09	100 000 EUR	Enel Finance International NV, 3.875%, 09/03/29	103 301	0,05	
100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.125%, 29/08/31	106 714	0,06					
100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.875%, perpetual	105 179	0,05					
100 000 EUR	UniCredit SpA, 0.925%, 18/01/28	92 854	0,05					
Italie – Total								
		855 489	0,44					

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 12,26 % (suite)				Obligations d'entreprise – 12,26 % (suite)				
Pays-Bas (suite)				Espagne				
100 000 EUR	Enel Finance International NV, 0.500%, 17/06/30	83 747	0,04	100 000 EUR	Abertis Infraestructuras SA, 2.375%, 27/09/27	97 412	0,05	
100 000 EUR	ING Groep NV, 2.000%, 20/09/28	95 056	0,05	100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.625%, 13/01/31	104 892	0,05	
100 000 EUR	ING Groep NV, 0.375%, 29/09/28	88 767	0,05	200 000 EUR	BanCo Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.375%, 14/10/29	212 436	0,11	
200 000 EUR	ING Groep NV, 2.500%, 15/11/30	191 478	0,10	100 000 EUR	Banco Santander SA, 1.125%, 23/06/27	93 325	0,05	
200 000 EUR	ING Groep NV, 0.250%, perpetual	173 548	0,09	100 000 EUR	Banco Santander SA, 3.875%, 16/01/28	102 386	0,05	
100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.700%, perpetual	104 522	0,05	100 000 EUR	Banco Santander SA, 4.875%, 18/10/31	106 481	0,05	
100 000 EUR	Naturgy Finance BV, 1.375%, 19/01/27	94 798	0,05	100 000 EUR	Banco Santander SA, 1.000%, 04/11/31	85 635	0,04	
100 000 EUR	Schlumberger Finance BV, 2.000%, 06/05/32	91 871	0,05	100 000 EUR	CaixaBank SA, 0.625%, 21/01/28	92 245	0,05	
100 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.625%, 20/01/27	96 338	0,05	100 000 EUR	CaixaBank SA, 0.750%, 26/05/28	91 162	0,05	
200 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.250%, 12/05/28	186 832	0,10	100 000 EUR	CaixaBank SA, 0.500%, 09/02/29	88 143	0,04	
100 000 EUR	Shell International Finance BV, 1.250%, 11/11/32	85 889	0,04	100 000 EUR	CaixaBank SA, 4.250%, 06/09/30	103 811	0,05	
120 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.875%, 10/03/28	121 363	0,06	100 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.375%, 11/03/32	88 706	0,05	
50 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.125%, 05/09/29	44 598	0,02	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.201%, 21/08/27	93 332	0,05	
60 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.375%, 06/09/30	55 061	0,03	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.788%, 12/03/29	94 153	0,05	
100 000 EUR	Stellantis NV, 0.625%, 30/03/27	92 150	0,05	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.592%, 25/05/31	96 087	0,05	
100 000 EUR	Stellantis NV, 4.500%, 07/07/28	105 282	0,05	Espagne – Total			1 550 206	0,79
100 000 EUR	Stellantis NV, 4.250%, 16/06/31	103 756	0,05	Suède				
100 000 EUR	Stellantis NV, 2.750%, 01/04/32	93 528	0,05	100 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.125%, 29/06/27	103 002	0,05	
100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.800%, 18/10/30	86 791	0,04	100 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.750%, 07/02/28	101 102	0,05	
100 000 EUR	Unilever Finance Netherlands BV, 1.750%, 25/03/30	93 836	0,05	200 000 EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.375%, 21/06/28	174 842	0,09	
100 000 EUR	Upjohn Finance BV, 1.908%, 23/06/32	83 981	0,04	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 3.375%, 17/02/28	100 922	0,05	
100 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.875%, 30/03/27	95 582	0,05	100 000 EUR	Svenska Handelsbanken AB, 1.375%, 23/02/29	91 327	0,05	
35 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.625%, 16/01/30	31 654	0,02	100 000 EUR	Swedbank AB, 2.100%, 25/05/27	96 253	0,05	
100 000 EUR	Volkswagen International Finance NV, 3.250%, 18/11/30	98 926	0,05	Suède – Total			667 448	0,34
100 000 EUR	Wintershall Dea Finance BV, 1.332%, 25/09/28	89 434	0,05	Royaume-Uni				
Pays-Bas – Total				100 000 EUR	Barclays PLC, 0.877%, 28/01/28	91 799	0,05	
3 435 388				100 000 EUR	Barclays PLC, 4.918%, 08/08/30	104 240	0,05	
1,75				100 000 EUR	BAT International Finance PLC, 2.250%, 16/01/30	88 990	0,05	
Norvège				100 000 EUR	BP Capital Markets PLC, 2.519%, 07/04/28	98 167	0,05	
100 000 EUR	DNB Bank ASA, 0.250%, 23/02/29	87 715	0,05	100 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.752%, 10/03/28	103 716	0,05	
100 000 EUR	DNB Bank ASA, 4.000%, perpetual	103 067	0,05	200 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 0.770%, 13/11/31	167 638	0,09	
Norvège – Total				100 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.856%, perpetual	106 016	0,05	
190 782				150 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 1.500%, 12/09/27	141 725	0,07	

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 12,26 % (suite)				Obligations d'entreprise – 12,26 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 EUR	NatWest Group PLC, 0.780%, 26/02/30	86 115	0,04	100 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.047%, 04/11/32	83 685	0,04
100 000 EUR	NatWest Group PLC, 4.771%, 16/02/29	103 991	0,05	200 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 0.597%, 17/02/33	160 824	0,08
100 000 EUR	NatWest Markets PLC, 1.375%, 02/03/27	94 116	0,05	100 000 EUR	Kraft Heinz Foods Co, 2.250%, 25/05/28	96 589	0,05
100 000 EUR	Thames Water Utilities Finance PLC, 4.375%, 18/01/31	94 375	0,05	100 000 EUR	Microsoft Corp, 3.125%, 06/12/28	103 004	0,05
100 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.625%, 24/11/30	90 697	0,05	100 000 EUR	Morgan Stanley, 4.813%, 25/10/28	104 654	0,05
Royaume-Uni – Total				États-Unis – Total			
		1 371 585	0,70			4 399 732	2,25
États-Unis				Total des obligations d'entreprise			
100 000 EUR	Altria Group Inc, 2.200%, 15/06/27	96 311	0,05			24 007 384	12,26
100 000 EUR	Apple Inc, 1.375%, 24/05/29	93 956	0,05	Obligations d'État – 2,04 %			
100 000 EUR	AT&T Inc, 1.600%, 19/05/28	93 861	0,05	Pays-Bas			
100 000 EUR	AT&T Inc, 0.800%, 04/03/30	86 919	0,04	4 000 000 EUR	State of Netherlands, 0.010%, 19/01/24	3 991 118	2,04
100 000 EUR	Bank of America Corp, 1.662%, 25/04/28	94 505	0,05	Pays-Bas – Total			
200 000 EUR	Bank of America Corp, 3.648%, 31/03/29	201 348	0,10			3 991 118	2,04
200 000 EUR	Bank of America Corp, 0.694%, 22/03/31	167 126	0,09	Total des obligations d'État			
100 000 EUR	Bank of America Corp, 2.824%, 27/04/33	93 826	0,05			3 991 118	2,04
100 000 EUR	Berkshire Hathaway Inc, 1.125%, 16/03/27	94 258	0,05	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
100 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.500%, 15/11/31	108 853	0,06			27 998 502	14,30
100 000 EUR	Citigroup Inc, 3.713%, 22/09/28	101 463	0,05	Autres valeurs mobilières			
100 000 EUR	Citigroup Inc, 1.500%, 26/10/28	92 090	0,05	Obligations d'entreprise – 14,74 %			
100 000 EUR	Citigroup Inc, 1.250%, 10/04/29	89 906	0,05	Australie			
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.125%, 15/03/29	87 197	0,04	3 000 000 EUR	Mizuho Bank Ltd, 0.010%, 11/01/24	2 995 651	1,53
100 000 EUR	Comcast Corp, 0.750%, 20/02/32	84 086	0,04	Australie – Total			
100 000 EUR	Exxon Mobil Corp, 0.835%, 26/06/32	82 807	0,04			2 995 651	1,53
100 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 1.500%, 21/05/27	94 645	0,05	Belgique			
100 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.250%, 07/02/29	89 477	0,05	2 000 000 EUR	KBC Bank NV, 0.010%, 31/01/24	1 993 057	1,02
100 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 4.000%, 21/09/29	103 190	0,05	1 000 000 EUR	Sumitomo Mitsui Banking Corp, 0.010%, 01/03/24	992 955	0,51
200 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 3.000%, 12/02/31	196 796	0,10	Belgique – Total			
100 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.250%, 29/01/27	95 005	0,05			2 986 012	1,53
175 000 EUR	International Business Machines Corp, 3.375%, 06/02/27	177 103	0,09	Finlande			
100 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.875%, 09/02/30	88 462	0,05	3 000 000 EUR	Nordea Bank Abp, 1.000%, 16/04/24	2 999 871	1,53
100 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 0.389%, 24/02/28	91 104	0,05	Finlande – Total			
100 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.638%, 18/05/28	94 461	0,05			2 999 871	1,53
125 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.812%, 12/06/29	116 909	0,06				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Autres valeurs mobilières (suite)				Certificats de dépôt – 52,69 % (suite)			
Obligations d'entreprise – 14,74 % (suite)				Autriche			
France				3 000 000 EUR Oesterreichische Kontrollbank AG, zero coupon, 16/01/24			
2 000 000	EUR Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA, 0.010%, 12/06/24	1 964 977	1,00	Autriche – Total			
France – Total				2 994 102 1,53			
Pays-Bas				Belgique			
500 000	EUR ABN AMRO Bank NV, 0.010%, 02/01/24	499 781	0,26	3 000 000 EUR Sumitomo Mitsui Banking Corp, zero coupon, 01/02/24			
Pays-Bas – Total				2 988 639 1,53			
Royaume-Uni				Canada			
1 000 000	EUR Bank of Montreal, 1.000%, 06/12/24	999 905	0,51	1 000 000 EUR Federation des caisses Desjardins du Quebec, zero coupon, 22/01/24			
Royaume-Uni – Total				Canada – Total			
17 413 680 8,89				997 466 0,51			
Total des obligations d'entreprise				France			
28 859 972 14,74				3 000 000 EUR Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, zero coupon, 30/01/24			
Total des autres valeurs mobilières				2 000 000 EUR Antalis SA, zero coupon, 08/01/24			
28 859 972 14,74				3 000 000 EUR Antalis SA, zero coupon, 18/01/24			
Fonds communs de placement – 6,95 %				2 000 000 EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, zero coupon, 08/03/24			
Irlande				1 000 000 EUR BRED Banque Populaire, 1.000%, 05/01/24			
96 824	EUR SPDR Morningstar Multi-Asset Global Infrastructure UCITS ETF	2 922 148	1,49	2 000 000 EUR HSBC Continental Europe SA, zero coupon, 28/03/24			
Irlande – Total				1 000 000 EUR La Banque Postale SA, zero coupon, 25/01/24			
2 922 148 1,49				10 715 000 EUR LMA SA, zero coupon, 02/01/24			
Luxembourg				3 000 000 EUR Managed & Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, zero coupon, 11/06/24			
666 354	USD State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund/Lux	5 805 326	2,97	2 000 000 EUR Oesterreichische Kontrollbank AG, zero coupon, 15/03/24			
510 000	EUR State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	4 872 236	2,49	3 000 000 EUR Satellite SAS, zero coupon, 05/01/24			
Luxembourg – Total				3 000 000 EUR Svenska Handelsbanken AB, zero coupon, 31/05/24			
10 677 562 5,46				France – Total			
Total des fonds communs de placement				35 530 548 18,15			
13 599 710 6,95				Allemagne			
Certificats de dépôt – 52,69 %				3 000 000 EUR Deutsche Bahn AG, zero coupon, 15/01/24			
Australie				2 000 000 EUR Deutsche Bank AG, zero coupon, 01/03/24			
2 000 000	EUR Australia & New Zealand Banking Group Ltd, zero coupon, 08/03/24	1 984 794	1,01	Allemagne – Total			
1 000 000	EUR Australia & New Zealand Banking Group Ltd, zero coupon, 24/10/24	970 827	0,50	4 980 620 2,55			
2 000 000	EUR zero coupon, 13/06/24	1 964 285	1,00	Irlande			
Australie – Total				2 000 000 EUR Caterpillar International Finance DAC, zero coupon, 20/03/24			
4 919 906 2,51				4 000 000 EUR Matchpoint Finance PLC, zero coupon, 06/02/24			
Autres valeurs mobilières (suite)				Irlande – Total			
Obligations d'entreprise – 14,74 % (suite)				5 965 028 3,05			
France				Luxembourg			
2 000 000	EUR Credit Agricole Corporate & Investment Bank SA, 0.010%, 12/06/24	1 964 977	1,00	2 000 000 EUR Albion Capital Corp SA/Albion Capital LLC, zero coupon, 25/03/24			
France – Total				3 000 000 EUR Sunderland Receivables SA, zero coupon, 04/01/24			
1 964 977 1,00				Luxembourg – Total			
Pays-Bas				4 977 971 2,54			
500 000	EUR ABN AMRO Bank NV, 0.010%, 02/01/24	499 781	0,26	Canada			
Pays-Bas – Total				1 000 000 EUR Federation des caisses Desjardins du Quebec, zero coupon, 22/01/24			
499 781 0,26				Canada – Total			
Royaume-Uni				997 466 0,51			
1 000 000	EUR Bank of Montreal, 1.000%, 06/12/24	999 905	0,51	France			
2 000 000	EUR Citibank NA, 0.010%, 23/04/24	1 974 827	1,01	3 000 000 EUR Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale, zero coupon, 30/01/24			
3 000 000	EUR Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp, 0.010%, 01/02/24	2 988 923	1,53	2 000 000 EUR Antalis SA, zero coupon, 08/01/24			
2 000 000	EUR National Australia Bank Ltd, 0.010%, 02/07/24	1 960 899	1,00	3 000 000 EUR Antalis SA, zero coupon, 18/01/24			
3 000 000	EUR Norinchukin Bank, 0.010%, 19/01/24	2 992 981	1,53	2 000 000 EUR Banque Federative du Credit Mutuel SA, zero coupon, 08/03/24			
500 000	EUR Standard Chartered Bank, 3.390%, 02/01/24	499 963	0,25	1 000 000 EUR BRED Banque Populaire, 1.000%, 05/01/24			
4 000 000	EUR Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 0.010%, 09/01/24	3 995 093	2,04	2 000 000 EUR HSBC Continental Europe SA, zero coupon, 28/03/24			
2 000 000	EUR Toronto-Dominion Bank, 1.000%, 09/08/24	2 001 089	1,02	1 000 000 EUR La Banque Postale SA, zero coupon, 25/01/24			
Royaume-Uni – Total				10 715 000 EUR LMA SA, zero coupon, 02/01/24			
17 413 680 8,89				3 000 000 EUR Managed & Enhanced Tap (Magenta) Funding ST, zero coupon, 11/06/24			
Total des obligations d'entreprise				2 000 000 EUR Oesterreichische Kontrollbank AG, zero coupon, 15/03/24			
28 859 972 14,74				3 000 000 EUR Satellite SAS, zero coupon, 05/01/24			
Total des autres valeurs mobilières				3 000 000 EUR Svenska Handelsbanken AB, zero coupon, 31/05/24			
28 859 972 14,74				France – Total			
Fonds communs de placement – 6,95 %				35 530 548 18,15			
Irlande				Allemagne			
96 824	EUR SPDR Morningstar Multi-Asset Global Infrastructure UCITS ETF	2 922 148	1,49	3 000 000 EUR Deutsche Bahn AG, zero coupon, 15/01/24			
Irlande – Total				2 000 000 EUR Deutsche Bank AG, zero coupon, 01/03/24			
2 922 148 1,49				Allemagne – Total			
Luxembourg				4 980 620 2,55			
666 354	USD State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund/Lux	5 805 326	2,97	Irlande			
510 000	EUR State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	4 872 236	2,49	2 000 000 EUR Caterpillar International Finance DAC, zero coupon, 20/03/24			
Luxembourg – Total				4 000 000 EUR Matchpoint Finance PLC, zero coupon, 06/02/24			
10 677 562 5,46				Irlande – Total			
Total des fonds communs de placement				5 965 028 3,05			
13 599 710 6,95				Luxembourg			
Certificats de dépôt – 52,69 %				2 000 000 EUR Albion Capital Corp SA/Albion Capital LLC, zero coupon, 25/03/24			
Australie				3 000 000 EUR Sunderland Receivables SA, zero coupon, 04/01/24			
2 000 000	EUR Australia & New Zealand Banking Group Ltd, zero coupon, 08/03/24	1 984 794	1,01	Luxembourg – Total			
1 000 000	EUR Australia & New Zealand Banking Group Ltd, zero coupon, 24/10/24	970 827	0,50	4 977 971 2,54			
2 000 000	EUR zero coupon, 13/06/24	1 964 285	1,00	Canada			
Australie – Total				1 000 000 EUR Federation des caisses Desjardins du Quebec, zero coupon, 22/01/24			
4 919 906 2,51				Canada – Total			
				997 466 0,51			

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Certificats de dépôt – 52,69 % (suite)				Certificats de dépôt – 52,69 % (suite)			
Pays-Bas				Suisse			
2 000 000	EUR Linde Finance BV, zero coupon, 17/01/24	1 995 871	1,02	3 000 000	EUR Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial, zero coupon, 15/01/24	2 994 429	1,53
1 000 000	EUR Linde Finance BV, zero coupon, 19/01/24	997 719	0,51				
2 000 000	EUR Linde Finance BV, zero coupon, 19/01/24	1 995 437	1,02	Suisse – Total			
4 000 000	EUR PACCAR Financial Europe BV, zero coupon, 12/01/24 Toyota Motor Finance	3 993 911	2,04	Royaume-Uni			
2 000 000	EUR Netherlands BV, zero coupon, 28/02/24	1 986 700	1,01	2 000 000	EUR Lloyds Bank PLC, zero coupon, 11/07/24	1 960 444	1,00
Pays-Bas – Total				Royaume-Uni – Total			
10 969 638				5 957 397			
5,60				3,04			
Norvège				États-Unis			
2 000 000	EUR Kommunalbanken AS, zero coupon, 15/01/24	1 996 305	1,02	4 000 000	EUR Colgate-Palmolive Co, zero coupon, 09/01/24	3 995 349	2,04
2 000 000	EUR Kommunalbanken AS, zero coupon, 23/01/24	1 994 570	1,02	3 000 000	EUR Mont Blanc Capital Corp, zero coupon, 14/02/24	2 984 659	1,52
Norvège – Total				3 000 000			
3 990 875				2,04			
Espagne				2 000 000 EUR Procter & Gamble Co, zero coupon, 07/02/24			
2 000 000	EUR Banco Santander SA, zero coupon, 07/03/24	1 984 944	1,01	2 000 000	EUR Sheffield Receivables Corp, zero coupon, 14/03/24	1 982 504	1,01
Espagne – Total				États-Unis – Total			
1 984 944				11 949 436			
1,01				6,10			
Suède				Total des certificats de dépôt			
2 000 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, zero coupon, 17/06/24	1 964 310	1,00	103 165 309			
Suède – Total				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
1 964 310				173 623 493			
1,00				88,68			

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 2,26 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
BCOM COMMODITY INDEX FUTURE, due 20/03/24	USD	324	2 893 459	24 344	0,01
EMINI RUSS 2000 FUTURE, due 15/03/24	USD	120	11 122 255	799 242	0,41
FTSE 100 INDEX FUTURE, due 15/03/24	GBP	50	4 475 618	115 714	0,06
HANG SENG INDEX FUTURE, due 30/01/24	HKD	7	695 154	25 705	0,01
MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	292	13 662 262	628 899	0,32
MSCI ENERGY INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	91	3 832 437	26 803	0,01
MSCI WORLD COMMODITY FUTURE, due 15/03/24	USD	113	1 930 948	99 666	0,05
MSCI WORLD FINANCIALS INDEX, due 15/03/24	USD	81	1 987 666	95 097	0,05
MSCI WORLD IT, due 15/03/24	USD	59	3 895 527	102 986	0,05
MSCI WORLD NTR INDEX, due 15/03/24	EUR	637	29 346 590	227 409	0,12
OMXS30 INDEX FUTURE, due 19/01/24	SEK	31	668 662	14 256	0,01
S&P EMINI INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	231	50 396 952	1 952 238	1,00
S&P/TSX 60 INDEX FUTURE, due 14/03/24	CAD	5	872 173	28 998	0,02
SPI 200 FUTURE, due 21/03/24	AUD	32	3 748 244	61 551	0,03
SWISS MARKET INDEX FUTURE, due 15/03/24	CHF	12	1 430 223	4 905	0,00
TOPIX INDEX FUTURE, due 07/03/24	JPY	12	1 823 114	18 493	0,01
XAI EMINI INDUSTR, due 15/03/24	USD	11	1 156 113	53 006	0,03
XAP CONS STAPLES, due 15/03/24	USD	44	2 917 666	86 873	0,05
XAU UTILITIES, due 15/03/24	USD	16	934 232	5 504	0,00
XAV HEALTH CARE, due 15/03/24	USD	20	2 520 798	83 683	0,04
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			140 310 093	4 455 372	2,28

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Produits dérivés (suite)

Contrats à terme standardisés – 2,26 % (suite)

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Moins-values latentes	% des actifs nets
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE, due 15/03/24	EUR	157	7 132 510	(40 426)	(0,02)
Moins-values latentes sur contrats à terme standardisés			7 132 510	(40 426)	(0,02)
Total des contrats à terme standardisés			147 442 603	4 414 946	2,26
Autres actifs/(passifs) nets				17 747 337	9,06
TOTAL DES ACTIFS NETS				195 785 776	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 2 909 751 EUR détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,30 %				Actions ordinaires et préférentielles – 98,30 % (<i>suite</i>)			
Autriche				Royaume-Uni			
13 142 EUR	Andritz AG	741 209	3,66	5 853 GBP	Astrazeneca PLC	715 981	3,53
12 106 EUR	OMV AG	481 456	2,37	321 514 GBP	Barclays PLC	570 580	2,82
Autriche – Total				60 083 EUR CNH Industrial NV			
		1 222 665	6,03			665 720	3,28
Belgique				273 530 GBP Direct Line Insurance Group PLC			
10 538 EUR	KBC Group NV	618 791	3,05	9 713 GBP	Rio Tinto PLC	654 835	3,23
8 472 EUR	Ucb SA	668 441	3,30	336 469 GBP	Serco Group PLC	629 427	3,11
Belgique – Total				Royaume-Uni – Total			
		1 287 232	6,35			3 810 890	18,80
France				Total des actions ordinaires et préférentielles			
4 806 EUR	Alten SA	646 888	3,19				19 928 791
21 961 EUR	AXA SA	647 630	3,20				98,30
10 112 EUR	BNP Paribas SA	632 910	3,12	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
17 578 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	570 582	2,81				19 928 791
4 929 EUR	Ipsen SA	531 839	2,62				98,30
7 361 EUR	Sanofi SA	660 723	3,26	Fonds communs de placement – 0,36 %			
4 888 EUR	SEB SA	552 344	2,72	Irlande			
20 930 EUR	Societe Generale SA	502 843	2,48	73 703 EUR	State Street EUR Liquidity LVNAV Fund	73 703	0,36
7 421 EUR	TotalEnergies SE	457 134	2,26				0,36
France – Total				Irlande – Total			
		5 202 893	25,66			73 703	0,36
Allemagne				Total des fonds communs de placement			
2 643 EUR	Allianz SE	639 474	3,15				73 703
7 753 EUR	Continental AG	596 361	2,94	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
22 149 EUR	Duerr AG	473 545	2,34				20 002 494
14 158 EUR	KION Group AG	547 490	2,70				98,66
2 683 EUR	SAP SE	374 225	1,85	Autres actifs/(passifs) nets			
Allemagne – Total							270 751
		2 631 095	12,98	TOTAL DES ACTIFS NETS			
Hongrie							20 273 245
24 034 HUF	Richter Gedeon Nyrt	550 207	2,71	100,00			
Hongrie – Total							
		550 207	2,71				
Irlande							
7 527 GBP	CRH PLC	469 933	2,32				
31 957 EUR	Glanbia PLC	476 479	2,35				
66 102 GBP	Grafton Group PLC	695 021	3,43				
19 448 EUR	Smurfit Kappa Group PLC	697 794	3,44				
Irlande – Total							
		2 339 227	11,54				
Italie							
27 100 EUR	Assicurazioni Generali SpA	517 745	2,56				
85 338 EUR	Enel SpA	574 325	2,83				
Italie – Total							
		1 092 070	5,39				
Espagne							
63 578 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	522 993	2,58				
Espagne – Total							
		522 993	2,58				
Suède							
58 011 SEK	Hexpol AB	635 737	3,13				
Suède – Total							
		635 737	3,13				
Suisse							
2 410 CHF	Roche Holding AG	633 782	3,13				
Suisse – Total							
		633 782	3,13				

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 96,51 %				Actions ordinaires et préférentielles – 96,51 % (suite)			
Autriche				Royaume-Uni			
22 559	EUR Andritz AG	1 272 328	3,31	92 515	EUR CNH Industrial NV	1 025 066	2,67
26 929	EUR OMV AG	1 070 966	2,79	Royaume-Uni – Total			1 025 066
Autriche – Total			6,10	Total des actions ordinaires et préférentielles			37 088 783
Belgique				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
22 455	EUR Colruyt Group N.V	916 164	2,39				37 088 783
16 836	EUR KBC Group NV	988 610	2,57	Fonds communs de placement – 2,89 %			96,51
14 856	EUR Ucb SA	1 172 138	3,05	Irlande			
Belgique – Total			8,01	1 109 631	EUR State Street EUR Liquidity LVNAV Fund	1 109 631	2,89
France				Irlande – Total			
8 440	EUR Alten SA	1 136 024	2,96	Total des fonds communs de placement			1 109 631
36 966	EUR AXA SA	1 090 127	2,84	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			38 198 414
18 491	EUR BNP Paribas SA	1 157 352	3,01	Autres actifs/(passifs) nets			231 025
36 497	EUR Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	1 184 693	3,08	TOTAL DES ACTIFS NETS			38 429 439
5 707	EUR Dassault Aviation SA	1 022 694	2,66				
9 009	EUR Ipsen SA	972 071	2,53				
99 402	EUR Orange SA	1 024 238	2,67				
14 958	EUR Publicis Groupe SA	1 256 472	3,27				
13 671	EUR Sanofi SA	1 227 109	3,19				
11 924	EUR SEB SA	1 347 412	3,51				
44 386	EUR Societe Generale SA	1 066 374	2,77				
France – Total			32,49				
Allemagne							
4 845	EUR Allianz SE	1 172 248	3,05				
9 722	EUR Bayerische Motoren Werke AG	979 783	2,55				
14 329	EUR Continental AG	1 102 187	2,87				
47 488	EUR Duerr AG	1 015 293	2,64				
15 736	EUR Henkel AG & Co KGaA–Preferred Stock	1 146 525	2,98				
24 612	EUR KION Group AG	951 746	2,48				
8 885	EUR SAP SE	1 239 280	3,22				
Allemagne – Total			19,79				
Irlande							
21 480	GBP CRH PLC	1 341 061	3,49				
74 528	EUR Glanbia PLC	1 111 212	2,89				
116 678	GBP Grafton Group PLC	1 226 796	3,19				
61 701	EUR Ryanair Holdings PLC	1 176 947	3,06				
32 711	EUR Smurfit Kappa Group PLC	1 173 671	3,06				
Irlande – Total			15,69				
Italie							
57 058	EUR Assicurazioni Generali SpA	1 090 093	2,84				
172 070	EUR Enel SpA	1 158 031	3,01				
68 827	EUR Leonardo SpA	1 027 932	2,67				
Italie – Total			8,52				
Espagne							
151 488	EUR Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1 246 140	3,24				
Espagne – Total			3,24				

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Fonds communs de placement – 1,35 %			
Actions ordinaires et préférentielles – 96,73 %				Irlande			
Royaume-Uni				373 683 USD State Street USD Liquidity LVNAV Fund			
72 175	USD CNH Industrial NV	879 092	3,17	Irlande – Total			
Royaume-Uni – Total				373 683 1,35			
États-Unis				Total des fonds communs de placement			
49 566	USD AT&T Inc	831 718	3,00	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
21 655	USD Avient Corp	900 198	3,25	27 187 569 98,08			
17 011	USD Avnet Inc	857 354	3,09	Autres actifs/(passifs) nets			
14 665	USD Bristol-Myers Squibb Co	752 461	2,71	533 447 1,92			
2 550	USD Cigna Group	763 598	2,75	TOTAL DES ACTIFS NETS			
15 868	USD Cisco Systems Inc	801 651	2,89	27 721 016 100,00			
16 312	USD Citigroup Inc	839 089	3,03				
11 129	USD Cognizant Technology Solutions Corp	840 573	3,03				
29 213	USD Coterra Energy Inc	745 516	2,69				
3 266	USD Cummins Inc	782 436	2,82				
4 755	USD F5 Inc	851 050	3,07				
23 288	USD frontdoor Inc	820 203	2,96				
38 222	USD Gen Digital Inc	872 226	3,15				
9 573	USD Hartford Financial Services Group Inc	769 478	2,78				
45 130	USD Hewlett Packard Enterprise Co	766 307	2,76				
5 302	USD Lear Corp	748 695	2,70				
5 850	USD M&T Bank Corp	801 918	2,89				
10 249	USD ManpowerGroup Inc	814 488	2,94				
8 896	USD Maximus Inc	746 019	2,69				
9 219	USD Micron Technology Inc	786 749	2,84				
25 287	USD NCR Atleos Corp	614 221	2,22				
33 073	USD NCR Corp	559 264	2,02				
9 818	USD Omnicom Group Inc	849 355	3,06				
7 177	USD Philip Morris International Inc	675 212	2,44				
8 754	USD Polaris Inc	829 617	2,99				
6 104	USD Qualcomm Inc	882 822	3,19				
4 504	USD Reinsurance Group of America Inc	728 657	2,63				
42 441	USD Resideo Technologies Inc	798 740	2,88				
22 021	USD Sensata Technologies Holding PLC	827 329	2,98				
12 049	USD Skechers USA Inc	751 135	2,71				
47 432	USD TEGNA Inc	725 710	2,62				
66 765	USD Warner Bros Discovery Inc	759 786	2,74				
17 091	USD Wells Fargo & Co	841 219	3,04				
États-Unis – Total		25 934 794	93,56				
Total des actions ordinaires et préférentielles		26 813 886	96,73				
Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé		26 813 886	96,73				

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)				
Actions ordinaires et préférentielles – 98,06 %				Actions ordinaires et préférentielles – 98,06 % (<i>suite</i>)				
Australie				Singapour				
99 585 AUD	Woodside Energy Group Ltd	2 110 583	3,22	81 000 SGD	United Overseas Bank Ltd	1 746 987	2,67	
Australie – Total				Singapour – Total				
		2 110 583	3,22			1 746 987	2,67	
Îles Caïmans				Taiwan				
768 000 HKD	Haitian International Holdings Ltd	1 900 194	2,90	209 000 TWD	Catcher Technology Co Ltd	1 321 126	2,01	
Îles Caïmans – Total				Taiwan – Total				
		1 900 194	2,90	160 000 TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3 091 510	4,72	
Chine				Taiwan – Total				
198 400 HKD	Alibaba Group Holding Ltd	1 920 848	2,93			4 412 636	6,73	
2 855 772 HKD	China Construction Bank Corp	1 700 615	2,59	Royaume-Uni				
754 600 HKD	CITIC Securities Co Ltd	1 540 404	2,35	26 603 AUD	Rio Tinto Ltd	2 462 575	3,76	
293 854 CNY	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	1 327 597	2,02	189 917 HKD	Standard Chartered PLC	1 589 421	2,42	
469 000 HKD	Haier Smart Home Co Ltd	1 324 375	2,02	Royaume-Uni – Total				
340 000 HKD	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	1 539 210	2,35			4 051 996	6,18	
1 098 404 HKD	Weichai Power Co Ltd	1 834 296	2,80	Total des actions ordinaires et préférentielles				
Chine – Total				64 286 728				98,06
		11 187 345	17,06	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				
Hong Kong				64 286 728				98,06
2 761 232 HKD	WH Group Ltd	1 782 227	2,72	Fonds communs de placement – 0,01 %				
Hong-Kong – Total				Irlande				
		1 782 227	2,72	8 105 USD	State Street USD Liquidity LVNAV Fund	8 105	0,01	
Indonésie				Irlande – Total				
4 311 300 IDR	Bank Mandiri Persero Tbk PT	1 694 055	2,58			8 105	0,01	
Indonésie – Total				Total des fonds communs de placement				
		1 694 055	2,58			8 105	0,01	
Japon				TOTAL DES INVESTISSEMENTS				
88 522 JPY	Alfresa Holdings Corp	1 504 774	2,29	64 294 833				98,07
134 900 JPY	Astellas Pharma Inc	1 613 288	2,46	Autres actifs/(passifs) nets				
59 689 JPY	KDDI Corp	1 899 311	2,90			1 268 053	1,93	
102 700 JPY	Kinden Corp	1 745 419	2,66	TOTAL DES ACTIFS NETS				
47 300 JPY	Komatsu Ltd	1 237 356	1,89			65 562 886	100,00	
56 300 JPY	Nihon Kohden Corp	1 782 288	2,72					
37 900 JPY	NOF Corp	1 883 440	2,87					
42 579 JPY	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	2 077 908	3,17					
48 500 JPY	Suntory Beverage & Food Ltd	1 599 695	2,44					
40 400 JPY	Suzuki Motor Corp	1 728 849	2,64					
109 100 JPY	TBS Holdings Inc	2 320 832	3,54					
108 810 JPY	Toyota Motor Corp	1 999 378	3,05					
44 500 JPY	Trend Micro Inc	2 382 508	3,63					
Japon – Total								
		23 775 046	36,26					
Corée								
7 577 KRW	Hyundai Mobis Co Ltd	1 394 323	2,13					
30 148 KRW	KB Financial Group Inc	1 266 408	1,93					
22 946 KRW	KT&G Corp	1 548 263	2,36					
60 914 KRW	Samsung Electronics Co Ltd–Preferred Stock	2 946 612	4,49					
21 934 KRW	Samsung Life Insurance Co Ltd	1 176 830	1,80					
44 699 KRW	Shinhan Financial Group Co Ltd	1 393 482	2,13					
Corée – Total								
		9 725 918	14,84					
Macao								
649 200 HKD	Sands China Ltd	1 899 741	2,90					
Macao – Total								
		1 899 741	2,90					

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,43 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,43 % (<i>suite</i>)			
Autriche				Taïwan			
29 075 EUR	Andritz AG	1 639 830	3,15	78 000 TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1 364 334	2,62
Autriche – Total				Taïwan – Total			
1 639 830 3,15				1 364 334 2,62			
Chine				Royaume-Uni			
267 708 CNY	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	1 094 891	2,10	125 038 USD	CNH Industrial NV	1 378 683	2,65
414 200 HKD	Haier Smart Home Co Ltd	1 058 823	2,04	Royaume-Uni – Total			
187 500 HKD	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	768 415	1,48	1 378 683 2,65			
Chine – Total				États-Unis			
2 922 129 5,62				38 282 USD	Avient Corp	1 440 622	2,77
France				27 225 USD	Bristol-Myers Squibb Co	1 264 577	2,43
11 245 EUR	Alten SA	1 513 577	2,91	5 539 USD	Cigna Group	1 501 519	2,89
23 005 EUR	BNP Paribas SA	1 439 883	2,77	29 580 USD	Cisco Systems Inc	1 352 810	2,60
France – Total				21 309 USD	Cognizant Technology Solutions Corp	1 456 994	2,80
2 953 460 5,68				5 934 USD	Cummins Inc	1 286 931	2,47
Allemagne				9 862 USD	F5 Inc	1 597 882	3,07
21 360 EUR	Continental AG	1 643 011	3,16	38 702 USD	frontdoor Inc	1 233 951	2,37
Allemagne – Total				11 553 USD	M&T Bank Corp	1 433 653	2,76
1 643 011 3,16				55 743 USD	NCR Corp	853 315	1,64
Hong Kong				17 133 USD	Omnicom Group Inc	1 341 760	2,58
3 040 197 HKD	WH Group Ltd	1 776 385	3,42	17 209 USD	Philip Morris International Inc	1 465 643	2,82
Hong-Kong – Total				16 178 USD	Polaris Inc	1 387 941	2,67
1 776 385 3,42				11 592 USD	Qualcomm Inc	1 517 721	2,92
Hongrie				9 980 USD	Reinsurance Group of America Inc	1 461 607	2,81
63 127 HUF	Richter Gedeon Nyrt	1 445 158	2,78	27 139 USD	Resideo Technologies Inc	462 369	0,89
Hongrie – Total				26 558 USD	Skechers USA Inc	1 498 778	2,88
1 445 158 2,78				29 646 USD	Wells Fargo & Co	1 320 940	2,54
Irlande				États-Unis – Total			
101 479 EUR	Glanbia PLC	1 513 052	2,91	23 879 013 45,91			
39 501 EUR	Smurfit Kappa Group PLC	1 417 296	2,72	Total des actions ordinaires et préférentielles			
Irlande – Total				51 715 214 99,43			
2 930 348 5,63				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
Italie				51 715 214 99,43			
98 176 EUR	Leonardo SpA	1 466 259	2,82	Fonds communs de placement – 0,01 %			
Italie – Total				Irlande			
1 466 259 2,82				7 772 USD	State Street USD Liquidity LVNAV Fund	7 036	0,01
Japon				Irlande – Total			
28 500 JPY	NOF Corp	1 282 132	2,47	7 036 0,01			
Japon – Total				Total des fonds communs de placement			
1 282 132 2,47				7 036 0,01			
Corée				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
38 470 KRW	Samsung Electronics Co Ltd– Preferred Stock	1 684 625	3,24	51 722 250 99,44			
51 149 KRW	Shinhan Financial Group Co Ltd	1 443 497	2,77				
Corée – Total							
3 128 122 6,01							
Suède							
133 877 SEK	Hexpol AB	1 467 145	2,82				
Suède – Total							
1 467 145 2,82							
Suisse							
17 607 CHF	Holcim AG	1 250 273	2,40				
4 521 CHF	Roche Holding AG	1 188 932	2,29				
Suisse – Total							
2 439 205 4,69							

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Produits dérivés

Contrats de change à terme – (0,36) %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold USD, due 26/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	77 976	83 654	2 315	0,00
Bought KRW / Sold USD, due 26/01/24	HSBC Bank PLC	175 894 000	133 581	2 868	0,00
Bought KRW / Sold USD, due 26/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	175 894 000	133 568	2 880	0,01
Bought KRW / Sold USD, due 26/01/24	UBS AG	175 894 000	133 582	2 868	0,01
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme				10 931	0,02
Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold EUR, due 26/01/24	Bank of Montreal	385 935	364 000	(14 940)	(0,03)
Bought USD / Sold EUR, due 26/01/24	Royal Bank of Canada	385 941	364 000	(14 934)	(0,03)
Bought USD / Sold EUR, due 26/01/24	Standard Chartered Bank	385 906	364 000	(14 966)	(0,03)
Bought USD / Sold KRW, due 26/01/24	HSBC Bank PLC	1 071 999	1 449 664 000	(49 810)	(0,10)
Bought USD / Sold KRW, due 26/01/24	UBS AG	2 279 911	3 077 603 000	(102 053)	(0,19)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme				(196 703)	(0,38)
Total des contrats de change à terme				(185 772)	(0,36)
Autres actifs/(passifs) nets				477 697	0,92
TOTAL DES ACTIFS NETS				52 014 175	100,00

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 %				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)					
Australie				France (suite)					
90 957 AUD	Aurizon Holdings Ltd	235 845	0,08	17 924 EUR	Sanofi SA	1 777 225	0,58		
43 911 AUD	BHP Group Ltd	1 510 418	0,50	26 768 EUR	Schneider Electric SE	5 375 103	1,77		
53 565 AUD	Dexus REIT	280 705	0,09	27 166 EUR	TotalEnergies SE	1 848 550	0,61		
95 395 AUD	GPT Group REIT	302 030	0,10	France – Total			19 125 938	6,29	
140 076 AUD	Medibank Pvt Ltd	340 268	0,11	Allemagne					
179 285 AUD	Mirvac Group REIT	255 680	0,08	14 989 EUR	Bayerische Motoren Werke AG	1 668 675	0,55		
63 191 AUD	Suncorp Group Ltd	597 189	0,20	2 928 EUR	Bayerische Motoren Werke AG–Preferred Stock	290 936	0,09		
Australie – Total			3 522 135	1,16	5 080 EUR	Beiersdorf AG	761 497	0,25	
Autriche				11 514 EUR	Evonik Industries AG	235 300	0,08		
5 444 EUR	voestalpine AG	171 752	0,06	2 974 EUR	Hannover Rueck SE	710 595	0,23		
Autriche – Total			171 752	0,06	7 011 EUR	Heidelberg Materials AG	626 856	0,21	
Belgique				5 233 EUR	Henkel AG & Co KGaA	375 626	0,12		
8 055 EUR	Ageas SA/NV	349 779	0,12	8 364 EUR	Henkel AG & Co KGaA–Preferred Stock	673 175	0,22		
Belgique – Total			349 779	0,12	3 403 EUR	Knorr-Bremse AG	221 037	0,07	
Bermudes				6 805 EUR	Muenchener Ruckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	2 819 681	0,93		
18 800 USD	Arch Capital Group Ltd	1 396 276	0,46	3 227 EUR	Talanx AG	230 458	0,08		
11 500 USD	Liberty Global Ltd	214 360	0,07	9 391 EUR	Volkswagen AG–Preferred Stock	1 159 787	0,38		
Bermudes – Total			1 610 636	0,53	Allemagne – Total			9 773 623	3,21
Canada				Hong Kong					
3 562 CAD	BCE Inc	140 929	0,05	188 000 HKD	HKT Trust & HKT Ltd	224 390	0,07		
44 764 CAD	Canadian Imperial Bank of Commerce	2 165 890	0,71	184 757 HKD	Sino Land Co Ltd	200 881	0,07		
7 500 CAD	CCL Industries Inc	338 939	0,11	20 000 HKD	Swire Pacific Ltd	169 302	0,06		
4 200 CAD	CGI Inc	452 139	0,15	51 000 HKD	Swire Properties Ltd	103 194	0,03		
7 200 CAD	Empire Co Ltd	191 385	0,06	Hong-Kong – Total			697 767	0,23	
14 000 CAD	Great-West Lifeco Inc	465 676	0,15	Irlande					
14 959 CAD	Hydro One Ltd	450 381	0,15	24 437 USD	Accenture PLC	8 575 188	2,82		
7 600 CAD	Quebecor Inc	181 671	0,06	35 562 GBP	CRH PLC	2 452 592	0,81		
5 400 CAD	Stantec Inc	435 653	0,14	19 200 USD	Medtronic PLC	1 581 696	0,52		
29 193 CAD	Sun Life Financial Inc	1 521 419	0,50	11 500 USD	Trane Technologies PLC	2 804 850	0,92		
15 974 CAD	Telus Corp	285 657	0,10	Irlande – Total			15 414 326	5,07	
8 347 CAD	Telus Corp	149 266	0,05	Israël					
Canada – Total			6 779 005	2,23	24 794 ILS	Bank Hapoalim BM	223 848	0,07	
Danemark				1 ILS	Isracard Ltd	2	0,00		
56 418 DKK	Novo Nordisk A/S	5 836 302	1,92	Israël – Total			223 850	0,07	
Danemark – Total			5 836 302	1,92	Italie				
Finlande				50 995 EUR	Assicurazioni Generali SpA	1 076 216	0,35		
18 650 EUR	Stora Enso OYJ	258 037	0,09	55 724 EUR	Banco BPM SpA	294 297	0,10		
Finlande – Total			258 037	0,09	114 461 EUR	Eni SpA	1 940 591	0,64	
France				25 560 EUR	Poste Italiane SpA	290 113	0,10		
2 827 EUR	Amundi SA	192 367	0,06	5 167 EUR	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	278 708	0,09		
3 032 EUR	Arkema SA	344 978	0,11	69 712 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale	581 714	0,19		
9 425 EUR	Bouygues SA	355 234	0,12	22 283 EUR	UniCredit SpA	604 666	0,20		
28 938 EUR	Carrefour SA	529 523	0,17	Italie – Total			5 066 305	1,67	
9 040 EUR	Cie de Saint-Gobain SA	665 669	0,22	Japon					
33 434 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	1 198 841	0,39	37 400 JPY	Advantest Corp	1 272 576	0,42		
4 490 EUR	Danone SA	291 046	0,10	9 200 JPY	AGC Inc	341 688	0,11		
2 059 EUR	Gecina SA REIT	250 420	0,08	9 700 JPY	Ajinomoto Co Inc	374 294	0,12		
11 883 EUR	L'Oreal SA	5 915 483	1,95						
9 358 EUR	Renault SA	381 499	0,13						

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)			
Japon (suite)				Pays-Bas			
28 100 JPY	Bridgestone Corp	1 164 023	0,38	20 444 EUR	ABN AMRO Bank NV	306 909	0,10
49 400 JPY	Canon Inc	1 268 464	0,42	5 664 EUR	Heineken Holding NV	479 266	0,16
10 100 JPY	Dai Nippon Printing Co Ltd	298 959	0,10	3 698 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV	106 271	0,03
17 900 JPY	Daiwa House Industry Co Ltd	542 409	0,18	5 582 EUR	Randstad NV	349 745	0,12
91 JPY	Daiwa House Investment Corp REIT	162 468	0,05	111 035 EUR	Stellantis NV	2 594 150	0,85
231 900 JPY	Honda Motor Co Ltd	2 411 444	0,79	Pays-Bas – Total			
14 900 JPY	Hulic Co Ltd	156 049	0,05	3 836 341			
18 400 JPY	Japan Post Bank Co Ltd	187 419	0,06	Nouvelle-Zélande			
104 600 JPY	Japan Post Holdings Co Ltd	934 485	0,31	91 666 NZD	Spark New Zealand Ltd	300 638	0,10
9 500 JPY	Japan Post Insurance Co Ltd	168 733	0,06	Nouvelle-Zélande – Total			
65 JPY	Japan Real Estate Investment Corp REIT	269 258	0,09	300 638			
59 800 JPY	Japan Tobacco Inc	1 546 113	0,51	Norvège			
20 900 JPY	Kajima Corp	349 346	0,11	8 673 NOK	Gjensidige Forsikring ASA	160 126	0,05
35 100 JPY	Kansai Electric Power Co Inc	466 075	0,15	4 326 NOK	Kongsberg Gruppen ASA	198 245	0,07
9 864 JPY	KDDI Corp	313 874	0,10	64 498 NOK	Norsk Hydro ASA	434 403	0,14
28 900 JPY	Mazda Motor Corp	312 308	0,10	34 664 NOK	Orkla ASA	269 101	0,09
4 400 JPY	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	190 694	0,06	3 586 NOK	Salmar ASA	200 986	0,07
11 900 JPY	MEIJI Holdings Co Ltd	282 686	0,09	8 091 NOK	Yara International ASA	287 766	0,09
79 000 JPY	Mitsubishi Electric Corp	1 120 166	0,37	Norvège – Total			
8 700 JPY	Mitsui Chemicals Inc	258 075	0,08	1 550 627			
21 400 JPY	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	841 853	0,28	Portugal			
12 300 JPY	NEC Corp	728 508	0,24	99 218 EUR	EDP - Energias de Portugal SA	499 233	0,16
1 472 825 JPY	Nippon Telegraph & Telephone Corp	1 800 027	0,59	14 368 EUR	Jeronimo Martins SGPS SA	365 682	0,12
210 JPY	Nomura Real Estate Master Fund Inc REIT	245 780	0,08	Portugal – Total			
31 800 JPY	Obayashi Corp	275 188	0,09	864 915			
1 900 JPY	Oracle Corp Japan	146 496	0,05	Singapour			
5 600 JPY	Otsuka Corp	230 904	0,08	106 200 SGD	CapitaLand Ascendas REIT	243 944	0,08
23 500 JPY	Ricoh Co Ltd	180 526	0,06	266 000 SGD	CapitaLand Integrated Commercial Trust REIT	415 404	0,14
7 800 JPY	SCSK Corp	154 694	0,05	282 900 SGD	Genting Singapore Ltd	214 464	0,07
7 000 JPY	Secom Co Ltd	504 220	0,17	71 200 SGD	Keppel Corp Ltd	381 612	0,13
18 800 JPY	Sekisui Chemical Co Ltd	271 038	0,09	42 400 SGD	Singapore Exchange Ltd	315 967	0,10
29 800 JPY	Sekisui House Ltd	662 034	0,22	77 200 SGD	Singapore Technologies Engineering Ltd	227 661	0,08
25 700 JPY	Shimizu Corp	170 738	0,06	95 000 SGD	Wilmar International Ltd	257 107	0,08
143 200 JPY	Softbank Corp	1 787 207	0,59	Singapour – Total			
14 700 JPY	Sompo Holdings Inc	719 047	0,24	2 056 159			
52 300 JPY	Sumitomo Corp	1 141 118	0,38	Afrique du Sud			
35 600 JPY	Sumitomo Electric Industries Ltd	453 396	0,15	23 992 GBP	Mondi PLC	470 244	0,15
6 200 JPY	Suntory Beverage & Food Ltd	204 497	0,07	Afrique du Sud – Total			
47 500 JPY	Tokio Marine Holdings Inc	1 189 016	0,39	470 244			
12 500 JPY	TOPPAN Holdings Inc	348 897	0,11	Espagne			
43 800 JPY	Yamaha Motor Co Ltd	391 304	0,13	12 686 EUR	Enagas SA	213 917	0,07
Japon – Total				15 697 EUR	Endesa SA	320 091	0,10
26 838 094				19 698 EUR	Redeia Corp SA	324 433	0,11
Jordanie				Espagne – Total			
7 775 GBP	Hikma Pharmaceuticals PLC	177 318	0,06	858 441			
Jordanie – Total				Suède			
177 318				16 407 SEK	Atlas Copco AB	282 544	0,09
7 775 GBP				76 934 SEK	Atlas Copco AB	1 140 515	0,38
177 318				19 765 SEK	Epiroc AB	345 961	0,12
7 775 GBP				3 766 SEK	Holmen AB	159 080	0,05
177 318				22 857 SEK	Securitas AB	223 584	0,07
7 775 GBP				17 254 SEK	SKF AB	344 640	0,11
177 318				43 411 SEK	Volvo AB	1 127 290	0,37
7 775 GBP				9 852 SEK	Volvo AB	261 016	0,09
177 318				Suède – Total			
177 318				3 884 630			

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)			
Suisse				États-Unis (suite)			
7 907	CHF Adecco Group AG	387 717	0,13	25 300	USD Cognizant Technology Solutions Corp	1 910 909	0,63
1 489	CHF Banque Cantonale Vaudoise	191 952	0,06	11 900	USD Colgate-Palmolive Co	948 549	0,31
923	CHF BKW AG	163 950	0,05	16 200	USD Constellation Energy Corp	1 893 618	0,62
48	CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	575 441	0,19	6 925	USD Cummins Inc	1 659 022	0,55
10 278	GBP Coca-Cola HBC AG	302 010	0,10	1 300	USD Deckers Outdoor Corp	868 959	0,29
7 600	USD Garmin Ltd	976 904	0,32	12 600	USD Dell Technologies Inc	963 900	0,32
1 682	CHF Geberit AG	1 077 168	0,35	19 729	USD Eaton Corp PLC	4 751 138	1,56
26 172	CHF Holcim AG	2 052 962	0,68	1 200	USD Erie Indemnity Co	401 904	0,13
23 221	CHF Novartis AG	2 341 551	0,77	49 100	USD Exelon Corp	1 762 690	0,58
2 600	CHF Swatch Group AG	136 078	0,04	7 300	USD Expeditors International of Washington Inc	928 560	0,31
1 291	CHF Swisscom AG	776 149	0,26	1 900	USD FactSet Research Systems Inc	906 395	0,30
Suisse – Total		8 981 882	2,95	1 200	USD Fair Isaac Corp	1 396 812	0,46
Royaume-Uni				21 200	USD Fastenal Co	1 373 124	0,45
48 906	GBP 3i Group PLC	1 509 381	0,50	440	USD First Citizens BancShares Inc/NC	624 347	0,21
93 172	GBP abrdn PLC	212 193	0,07	7 000	USD Fox Corp	193 550	0,06
26 441	GBP Aviva PLC	146 524	0,05	13 388	USD Franklin Resources Inc	398 829	0,13
49 237	GBP Barratt Developments PLC	353 129	0,12	28 900	USD General Mills Inc	1 882 546	0,62
5 256	GBP Berkeley Group Holdings PLC	314 112	0,10	8 400	USD Graco Inc	728 784	0,24
83 525	GBP J Sainsbury PLC	322 201	0,10	15 386	USD Hartford Financial Services Group Inc	1 236 727	0,41
8 200	USD Pentair PLC	596 222	0,19	6 300	USD Henry Schein Inc	476 973	0,16
18 304	AUD Rio Tinto Ltd	1 694 357	0,56	7 100	USD Hershey Co	1 323 724	0,44
Royaume-Uni – Total		5 148 119	1,69	63 948	USD Hewlett Packard Enterprise Co	1 085 837	0,36
États-Unis				14 500	USD Hormel Foods Corp	465 595	0,15
6 095	USD A O Smith Corp	502 472	0,17	35 300	USD Host Hotels & Resorts Inc REIT	687 291	0,23
11 685	USD Abbott Laboratories	1 286 168	0,42	44 678	USD HP Inc	1 344 361	0,44
12 200	USD Adobe Inc	7 278 520	2,39	2 700	USD Hubbell Inc	888 111	0,29
1 200	USD Air Products and Chemicals Inc	328 560	0,11	46 900	USD Intel Corp	2 356 725	0,77
7 500	USD Akamai Technologies Inc	887 625	0,29	16 500	USD International Paper Co	596 475	0,20
47 100	USD Alphabet Inc	6 637 803	2,18	14 400	USD Iron Mountain Inc REIT	1 007 712	0,33
2 800	USD Alphabet Inc	391 132	0,13	6 500	USD Jabil Inc	828 100	0,27
4 500	USD Ameriprise Financial Inc	1 709 235	0,56	16 482	USD Johnson & Johnson	2 583 389	0,85
45 979	USD Apple Inc	8 852 337	2,91	14 387	USD Juniper Networks Inc	424 129	0,14
14 189	USD Applied Materials Inc	2 299 611	0,76	13 003	USD Kellanova	726 998	0,24
2 281	USD Arthur J Gallagher & Co	512 951	0,17	3 957	USD Kenvue Inc	85 194	0,03
2 600	USD Assurant Inc	438 074	0,14	24 000	USD Kroger Co	1 097 040	0,36
7 094	USD AvalonBay Communities Inc REIT	1 328 139	0,44	1 600	USD Lennox International Inc	716 032	0,24
37 866	USD Bank of New York Mellon Corp	1 970 925	0,65	13 000	USD LyondellBasell Industries NV	1 236 040	0,41
21 400	USD Berkshire Hathaway Inc	7 632 524	2,51	3 100	USD Manhattan Associates Inc	667 492	0,22
2 600	USD BlackRock Inc	2 110 680	0,69	5 700	USD Marathon Petroleum Corp	845 652	0,28
11 300	USD BorgWarner Inc	405 105	0,13	10 400	USD Merck & Co Inc	1 133 808	0,37
6 200	USD Builders FirstSource Inc	1 035 028	0,34	21 300	USD Meta Platforms Inc	7 539 348	2,48
7 494	USD Bunge Global SA	756 519	0,25	33 224	USD Microsoft Corp	12 493 553	4,11
13 600	USD Cadence Design Systems Inc	3 704 232	1,22	9 200	USD Molson Coors Beverage Co	563 132	0,18
9 600	USD Campbell Soup Co	415 008	0,14	14 200	USD Mondelez International Inc	1 028 506	0,34
12 400	USD Cardinal Health Inc	1 249 920	0,41	11 300	USD NRG Energy Inc	584 210	0,19
5 300	USD Cboe Global Markets Inc	946 368	0,31	11 700	USD Nvidia Corp	5 794 074	1,91
7 986	USD Cbre Group Inc	743 417	0,24	160	USD NVR Inc	1 120 072	0,37
8 600	USD Cencora Inc	1 766 268	0,58	9 900	USD Omnicom Group Inc	856 449	0,28
5 700	USD CH Robinson Worldwide Inc	492 423	0,16	9 600	USD Oracle Corp	1 012 128	0,33
139 300	USD Cisco Systems Inc	7 037 436	2,31	4 491	USD Owens Corning	665 701	0,22
9 600	USD CME Group Inc	2 021 760	0,66				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)					
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)					
26 250	USD Paccar Inc	2 563 312	0,84	5 300	USD Tradeweb Markets Inc	481 664	0,16		
4 524	USD Packaging Corp of America	737 005	0,24	11 390	USD Travelers Cos Inc	2 169 681	0,71		
1 841	USD Procter & Gamble Co	269 780	0,09	180 800	USD Verizon Communications Inc	6 816 160	2,24		
11 100	USD PulteGroup Inc	1 145 742	0,38	3 500	USD Vertex Pharmaceuticals Inc	1 424 115	0,47		
3 000	USD Reliance Steel & Aluminum Co	839 040	0,28	3 900	USD Vertiv Holdings Co	187 317	0,06		
10 955	USD Republic Services Inc	1 806 589	0,59	1 600	USD Watsco Inc	685 552	0,23		
5 200	USD Robert Half Inc	457 184	0,15	1 800	USD Westlake Corp	251 928	0,08		
3 000	USD Rollins Inc	131 010	0,04	2 250	USD WW Grainger Inc	1 864 552	0,61		
5 595	USD SEI Investments Co	355 562	0,12	8 899	USD Xylem Inc	1 017 690	0,33		
2 600	USD Snap-on Inc	750 984	0,25	États-Unis – Total			176 726 529	58,12	
7 900	USD Steel Dynamics Inc	932 990	0,31	Total des actions ordinaires et préférentielles			300 523 392	98,84	
2 400	USD Super Micro Computer Inc	682 224	0,22	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				300 523 392	98,84
10 000	USD Synchrony Financial	381 900	0,13	TOTAL DES INVESTISSEMENTS				300 523 392	98,84
7 700	USD Synopsis Inc	3 964 807	1,30						
24 561	USD Texas Instruments Inc	4 186 668	1,38						
3 807	USD Tractor Supply Co	818 619	0,27						

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,00 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
MSCI EAFE INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	9	1 013 580	8 530	0,00
S&P EMINI INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	9	2 169 000	2 900	0,00
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			3 182 580	11 430	0,00
Total des contrats à terme standardisés			3 182 580	11 430	0,00
Autres actifs/(passifs) nets				3 513 180	1,16
TOTAL DES ACTIFS NETS				304 048 002	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 122 886 USD détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,42 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,42 % (suite)			
Autriche				France (suite)			
39 841	EUR voestalpine AG	1 137 859	0,32	683	EUR Kering SA	272 517	0,08
Autriche – Total				38 855	EUR Klepierre SA REIT	958 941	0,27
Belgique				18 871	EUR Legrand SA	1 775 761	0,50
26 539	EUR Ageas SA/NV	1 043 248	0,29	11 256	EUR L'Oreal SA	5 072 517	1,42
20 962	EUR Anheuser-Busch InBev SA/NV	1 224 600	0,34	8 819	EUR LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	6 469 619	1,81
14 316	EUR KBC Group NV	840 635	0,24	1 051	EUR Pernod Ricard SA	167 897	0,05
24	EUR Lotus Bakeries NV	197 520	0,06	21 278	EUR Publicis Groupe SA	1 787 352	0,50
12 228	EUR Syensqo SA	1 152 611	0,32	987	EUR Renault SA	36 425	0,01
15 704	EUR Umicore SA	391 030	0,11	53 128	EUR Sanofi SA	4 768 769	1,33
Belgique – Total				14 840	EUR Schneider Electric SE	2 697 615	0,75
Danemark				10 118	EUR Sodexo SA	1 007 955	0,28
183	DKK AP Moller - Maersk A/S	298 021	0,08	573	EUR Teleperformance SE	75 665	0,02
108	DKK AP Moller - Maersk A/S	173 563	0,05	97 771	EUR TotalEnergies SE	6 022 694	1,68
7 876	DKK Carlsberg AS	894 673	0,25	5 150	EUR Veolia Environnement SA	147 084	0,04
30 038	DKK Demant A/S	1 192 725	0,33	12 724	EUR Vinci SA	1 446 719	0,40
3 522	DKK Genmab A/S	1 018 156	0,28	France – Total			
127 363	DKK Novo Nordisk A/S	11 927 202	3,34	62 357 132			
14 729	DKK Novozymes A/S	733 233	0,21	17,44			
11 446	DKK Pandora A/S	1 432 868	0,40	Allemagne			
168	DKK Vestas Wind Systems A/S	4 830	0,00	6 794	EUR adidas AG	1 251 183	0,35
Danemark – Total				19 180	EUR Allianz SE	4 640 601	1,30
Finlande				27 658	EUR BASF SE	1 349 157	0,38
148 520	EUR Nokia Oyj	453 283	0,13	22 007	EUR Bayerische Motoren Werke AG	2 217 866	0,62
214 431	SEK Nordea Bank Abp	2 402 321	0,67	1 959	EUR Bayerische Motoren Werke AG–Preferred Stock	176 212	0,05
38 486	EUR Sampo Oyj	1 524 430	0,43	5 772	EUR Beiersdorf AG	783 260	0,22
34 342	EUR Stora Enso OYJ	430 134	0,12	21 994	EUR Commerzbank AG	236 655	0,07
1 700	EUR UPM-Kymmene Oyj	57 902	0,01	26 384	EUR Daimler Truck Holding AG	897 584	0,25
76 755	EUR Wartsila OYJ Abp	1 007 409	0,28	158 906	EUR Deutsche Bank AG	1 964 714	0,55
Finlande – Total				1 301	EUR Deutsche Boerse AG	242 637	0,07
France				55 649	EUR Deutsche Lufthansa AG	447 863	0,12
18 390	EUR Air Liquide SA	3 238 847	0,91	59 949	EUR Deutsche Post AG	2 689 012	0,75
12 422	EUR Arkema SA	1 279 466	0,36	169 488	EUR Deutsche Telekom AG	3 686 364	1,03
73 731	EUR AXA SA	2 174 327	0,61	123 857	EUR EON SE	1 504 863	0,42
54 608	EUR BNP Paribas SA	3 417 915	0,96	11 548	EUR Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	438 362	0,12
8 228	EUR Capgemini SE	1 553 035	0,43	51 671	EUR Fresenius SE & Co KGaA	1 450 405	0,41
60 319	EUR Carrefour SA	999 184	0,28	30 338	EUR GEA Group AG	1 143 439	0,32
33 211	EUR Cie de Saint-Gobain SA	2 213 845	0,62	3 648	EUR Heidelberg Materials AG	295 269	0,08
44 729	EUR Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	1 451 903	0,41	3 673	EUR Henkel AG & Co KGaA–Preferred Stock	267 615	0,07
2 205	EUR Covivio SA REIT	107 339	0,03	21 587	EUR Infineon Technologies AG	815 989	0,23
7 337	EUR Danone SA	430 535	0,12	6 555	EUR Knorr-Bremse AG	385 434	0,11
6 682	EUR Dassault Aviation SA	1 197 414	0,33	43 295	EUR Mercedes-Benz Group AG	2 708 102	0,76
7 953	EUR Dassault Systemes SE	351 801	0,10	6 964	EUR MTU Aero Engines AG	1 359 721	0,38
11 582	EUR Edenred SE	627 050	0,18	3 391	EUR Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	1 271 964	0,36
12 720	EUR Eiffage SA	1 234 094	0,34	40 775	EUR SAP SE	5 687 297	1,59
91 778	EUR Engie SA	1 460 922	0,41	696	EUR Sartorius AG–Preferred Stock	231 907	0,06
5 364	EUR EssilorLuxottica SA	974 102	0,27	19 984	EUR Scout24 SE	1 282 174	0,36
16 636	EUR Eurazeo SE	1 195 297	0,33	33 023	EUR Siemens AG	5 611 268	1,57
11 374	EUR Gecina SA REIT	1 252 278	0,35	14 408	EUR Siemens Healthineers AG	757 861	0,21
22 236	EUR Getlink SE	368 339	0,10				
1 613	EUR Hermes International SCA	3 095 025	0,87				
9 517	EUR Ipsen SA	1 026 884	0,29				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,42 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,42 % (suite)				
Allemagne (suite)				Norvège (suite)				
2 117	EUR Talanx AG	136 864	0,04	58 666	NOK Telenor ASA	609 748	0,17	
4 191	EUR Vonovia SE	119 611	0,03	1 686	NOK Yara International ASA	54 284	0,02	
Allemagne – Total				Norvège – Total				
46 051 253				12,88				
Irlande				Portugal				
23 300	USD AerCap Holdings NV	1 567 606	0,44	32 307	EUR Galp Energia SGPS SA	430 975	0,12	
147 619	EUR AIB Group PLC	572 762	0,16	Portugal – Total				
29 093	GBP CRH PLC	1 816 364	0,51	430 975				
12 096	EUR Kingspan Group PLC	948 326	0,26	Espagne				
26 035	EUR Smurfit Kappa Group PLC	934 136	0,26	34 640	EUR ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	1 391 142	0,39	
Irlande – Total				787	EUR Aena SME SA	129 147	0,04	
5 839 194				1,63	590	EUR Amadeus IT Group SA	38 279	0,01
Italie				349 821	EUR Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	2 877 628	0,81	
460 864	EUR Enel SpA	3 101 615	0,87	880 337	EUR Banco Santander SA	3 327 234	0,93	
145 144	EUR Eni SpA	2 227 670	0,62	16 926	EUR Corp ACCIONA Energias Renovables SA	475 282	0,13	
2 517	EUR Ferrari NV	768 188	0,22	22 278	EUR EDP Renovaveis SA	412 700	0,12	
570 719	EUR Intesa Sanpaolo SpA	1 508 696	0,42	22 452	EUR Endesa SA	414 464	0,12	
97 695	EUR Poste Italiane SpA	1 003 816	0,28	311 227	EUR Iberdrola SA	3 694 264	1,03	
6 357	EUR Prysmian SpA	261 718	0,07	22 802	EUR Industria de Diseno Textil SA	899 083	0,25	
11 856	EUR Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	578 929	0,16	1 728	EUR Naturgy Energy Group SA	46 656	0,01	
99 990	EUR UniCredit SpA	2 456 254	0,69	438 221	EUR Telefonica SA	1 548 673	0,43	
Italie – Total				Espagne – Total				
11 906 886				3,33				
Jordanie				Suède				
4 524	GBP Hikma Pharmaceuticals PLC	93 401	0,03	18 159	SEK Alfa Laval AB	658 014	0,18	
Jordanie – Total				18 849	SEK Assa Abloy AB	491 522	0,14	
93 401				0,03	34 177	SEK Atlas Copco AB	532 802	0,15
Luxembourg				26 746	SEK Atlas Copco AB	358 936	0,10	
56 308	EUR ArcelorMittal SA	1 445 708	0,40	47 382	SEK Essity AB	1 064 047	0,30	
Luxembourg – Total				49 366	SEK Geringe AB	994 637	0,28	
1 445 708				0,40	72 110	SEK H & M Hennes & Mauritz AB	1 144 044	0,32
Pays-Bas				12 099	SEK Hexagon AB	131 451	0,04	
19 223	EUR Akzo Nobel NV	1 438 265	0,40	4 230	SEK Holmen AB	161 753	0,04	
3 393	EUR ASM International NV	1 594 540	0,45	22 189	SEK Industrivarden AB	654 359	0,18	
13 395	EUR ASML Holding NV	9 131 371	2,55	63 061	SEK Investor AB	1 322 681	0,37	
7 272	EUR BE Semiconductor Industries NV	992 264	0,28	23 145	SEK Saab AB	1 263 230	0,35	
1 090	EUR EXOR NV	98 645	0,03	63 130	SEK Securitas AB	559 026	0,16	
3 030	EUR Heineken NV	278 578	0,08	123 863	SEK Skandinaviska Enskilda Banken AB	1 544 324	0,43	
136 136	EUR ING Groep NV	1 841 376	0,51	3 467	SEK Skanska AB	56 789	0,01	
9 669	EUR Koninklijke Ahold Delhaize NV	251 539	0,07	70 085	SEK SKF AB	1 267 290	0,35	
409 726	EUR Koninklijke KPN NV	1 277 526	0,36	12 983	SEK Svenska Cellulosa AB SCA	176 216	0,05	
77 374	EUR Koninklijke Philips NV	1 631 431	0,46	54 285	SEK Swedbank AB	991 344	0,28	
28 513	EUR NN Group NV	1 019 340	0,28	29 464	SEK Swedish Orphan Biovitrum AB	706 660	0,20	
27 534	EUR Prosus NV	743 005	0,21	44 220	SEK Tele2 AB	343 750	0,10	
10 036	EUR Qiagen Nv	395 418	0,11	17 079	SEK Telefonaktiebolaget LM Ericsson	96 821	0,03	
131 354	EUR Stellantis NV	2 778 137	0,78	101 480	SEK Volvo AB	2 385 566	0,67	
17 217	EUR Wolters Kluwer NV	2 215 828	0,62	7 431	SEK Volvo AB	178 224	0,05	
Pays-Bas – Total				Suède – Total				
25 687 263				7,19				
Norvège				Suède				
2 990	NOK DNB Bank ASA	57 569	0,02	17 083	SEK Skanska AB	486	4,78	
25 190	NOK Equinor ASA	723 355	0,20					
28 576	NOK Kongsberg Gruppen ASA	1 185 477	0,33					
5 949	NOK Mowi ASA	96 512	0,03					
184 507	NOK Norsk Hydro ASA	1 124 953	0,31					
25 230	NOK Orkla ASA	177 309	0,05					

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,42 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,42 % (suite)			
Suisse				Royaume-Uni (suite)			
86 170	CHF ABB Ltd	3 457 074	0,97	10 920	GBP Berkeley Group Holdings PLC	590 782	0,16
24 007	CHF Adecco Group AG	1 065 654	0,30	536 220	GBP BP PLC	2 884 602	0,81
19 188	CHF Alcon Inc	1 354 696	0,38	103 828	GBP British American Tobacco PLC	2 750 483	0,77
	280 CHF Barry Callebaut AG	427 350	0,12	75 587	GBP BT Group PLC	107 816	0,03
7 128	CHF BKW AG	1 146 179	0,32	44 106	GBP Burberry Group PLC	720 739	0,20
	112 CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	1 215 494	0,34	847 308	GBP Centrica PLC	1 375 303	0,38
	5 CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	548 547	0,15	25 430	USD Coca-Cola Europacific Partners PLC	1 536 412	0,43
13 381	CHF Cie Financiere Richemont SA	1 665 917	0,47	83 757	GBP Compass Group PLC	2 074 283	0,58
47 338	GBP Coca-Cola HBC AG	1 259 210	0,35	96 066	GBP Diageo PLC	3 166 249	0,89
	407 CHF Geberit AG	235 954	0,07	3 307	GBP Endeavour Mining PLC	67 054	0,02
	466 CHF Givaudan SA	1 746 255	0,49	5 567	GBP Experian PLC	205 712	0,06
23 512	CHF Holcim AG	1 669 586	0,47	215 383	GBP GSK PLC	3 604 595	1,01
24 846	CHF Julius Baer Group Ltd	1 260 033	0,35	29 793	GBP Hargreaves Lansdown PLC	252 364	0,07
	5 471 CHF Kuehne & Nagel International AG	1 705 332	0,48	838 809	GBP HSBC Holdings PLC	6 151 710	1,72
	9 930 CHF Logitech International SA	851 879	0,24	15 989	GBP Informa PLC	144 145	0,04
	1 636 CHF Lonza Group AG	622 389	0,17	19 070	GBP InterContinental Hotels Group PLC	1 560 322	0,44
90 739	CHF Nestle SA	9 516 711	2,66	68 540	GBP J Sainsbury PLC	239 348	0,07
87 842	CHF Novartis AG	8 018 629	2,24	298 110	GBP Kingfisher PLC	837 020	0,23
	1 672 CHF Partners Group Holding AG	2 181 428	0,61	412 043	GBP Lloyds Banking Group PLC	226 866	0,06
23 323	CHF Roche Holding AG	6 133 481	1,71	15 678	GBP London Stock Exchange Group PLC	1 677 934	0,47
	1 055 CHF Schindler Holding AG	238 636	0,07	489 278	GBP M&G PLC	1 255 763	0,35
	2 201 CHF Sika AG	647 946	0,18	221 158	GBP Melrose Industries PLC	1 448 135	0,40
	346 CHF Sonova Holding AG	102 118	0,03	52 727	GBP National Grid PLC	643 778	0,18
48 132	EUR STMicroelectronics NV	2 177 732	0,61	15 501	GBP Next PLC	1 452 198	0,41
	4 123 CHF Straumann Holding AG	601 335	0,17	30 302	GBP Reckitt Benckiser Group PLC	1 895 343	0,53
	2 852 CHF Swatch Group AG	701 244	0,20	97 148	GBP RELX PLC	3 486 675	0,98
	2 689 CHF Swiss Life Holding AG	1 689 069	0,47	57 655	GBP Rio Tinto PLC	3 887 011	1,09
	4 198 CHF Swiss Prime Site AG	405 699	0,11	625 199	GBP Rolls-Royce Holdings PLC	2 162 331	0,60
	1 735 CHF Swiss Re AG	176 462	0,05	116 026	GBP Sage Group PLC	1 569 948	0,44
	1 420 CHF Temenos AG	119 468	0,03	277 732	GBP Shell PLC	8 241 944	2,31
	1 088 CHF VAT Group AG	493 254	0,14	19 386	GBP Smiths Group PLC	394 531	0,11
	7 695 CHF Zurich Insurance Group AG	3 638 397	1,02	586 392	GBP Tesco PLC	1 965 854	0,55
Suisse – Total				78 621 219			
				21,99			
Royaume-Uni				Royaume-Uni – Total			
74 589	GBP 3i Group PLC	2 083 947	0,58	75 242	GBP Unilever PLC	3 299 599	0,92
447 789	GBP abrdrn PLC	923 195	0,26	43 519	GBP United Utilities Group PLC	532 105	0,15
26 692	GBP Ashtead Group PLC	1 682 480	0,47	33 049	GBP Whitbread PLC	1 394 382	0,39
51 568	GBP Associated British Foods PLC	1 408 626	0,39	Total des actions ordinaires et préférentielles			355 411 687
51 057	GBP Astrazeneca PLC	6 245 660	1,75	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			355 411 687
85 295	GBP Aviva PLC	427 888	0,12	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			99,42
753 732	GBP Barclays PLC	1 337 624	0,37				
109 119	GBP Barratt Developments PLC	708 463	0,20				

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,00 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
FTSE 100 INDEX FUTURE, due 15/03/24	GBP	3	268 537	6 803	0,00
SWISS MARKET INDEX FUTURE, due 15/03/24	CHF	1	119 185	409	0,00
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés				7 212	0,00

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Produits dérivés (suite)

Contrats à terme standardisés – 0,00 % (suite)

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Moins-values latentes	% des actifs nets
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE, due 15/03/24	EUR	11	499 730	(3 438)	(0,00)
Moins-values latentes sur contrats à terme standardisés			499 730	(3 438)	(0,00)
Total des contrats à terme standardisés			887 452	3 774	0,00
Autres actifs/(passifs) nets				2 081 249	0,58
TOTAL DES ACTIFS NETS				357 496 710	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 55 046 EUR détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,49 %				Actions ordinaires et préférentielles – 98,49 % <i>(suite)</i>			
Bermudes				États-Unis (suite)			
2 316	USD Everest Group Ltd	818 891	0,14	8 586	USD American Homes 4 Rent REIT	308 753	0,05
Bermudes – Total				30 573	USD American International Group Inc	2 071 321	0,35
				5 902	USD Ameriprise Financial Inc	2 241 757	0,38
Canada				7 361	USD Amgen Inc	2 120 115	0,36
5 097	CAD Alimentation Couche-Tard Inc	301 622	0,05	10 376	USD Amphenol Corp	1 028 573	0,18
37 430	CAD AltaGas Ltd	789 703	0,13	196 796	USD Apple Inc	37 889 134	6,46
118 928	CAD ARC Resources Ltd	1 774 089	0,30	21 248	USD Applied Materials Inc	3 443 663	0,59
8 330	CAD Bank of Nova Scotia	407 466	0,07	17 474	USD Archer-Daniels-Midland Co	1 261 972	0,22
66 099	CAD CAE Inc	1 433 666	0,24	11 183	USD Automatic Data Processing Inc	2 605 304	0,44
7 464	CAD Canadian National Railway Co	942 764	0,16	762	USD AutoZone Inc	1 970 235	0,34
65 937	CAD Empire Co Ltd	1 752 686	0,30	4 283	USD Axon Enterprise Inc	1 106 427	0,19
7 413	CAD Firstservice Corp	1 206 735	0,21	16 236	USD Baker Hughes Co	554 946	0,09
31 051	CAD Great-West Lifeco Inc	1 032 835	0,18	145 763	USD Bank of America Corp	4 907 840	0,84
26 402	CAD iA Financial Corp Inc	1 808 655	0,31	4 398	USD Bank of New York Mellon Corp	228 916	0,04
299 297	CAD Kinross Gold Corp	1 820 387	0,31	8 310	USD Becton Dickinson and Co	2 026 227	0,35
20 416	CAD Loblaw Cos Ltd	1 986 171	0,34	12 372	USD Berkshire Hathaway Inc	4 412 598	0,75
1 754	USD Lululemon Athletica Inc	896 803	0,15	961	USD Booking Holdings Inc	3 408 878	0,58
103 158	CAD Manulife Financial Corp	2 290 661	0,39	7 177	USD Boston Scientific Corp	414 902	0,07
45 025	CAD Open Text Corp	1 901 594	0,32	45 418	USD Bristol-Myers Squibb Co	2 330 398	0,40
4 977	USD Ovintiv Inc	218 590	0,04	7 369	USD Broadcom Inc	8 225 646	1,40
59 726	CAD Power Corp of Canada	1 716 228	0,29	4 035	USD Broadridge Financial Solutions Inc	830 201	0,14
1 130	CAD Royal Bank of Canada	114 834	0,02	12 226	USD Builders FirstSource Inc	2 041 008	0,35
19 133	CAD Shopify Inc	1 496 861	0,26	5 691	USD Bunge Global SA	574 506	0,10
11 846	CAD TFI International Inc	1 619 235	0,28	9 358	USD Cadence Design Systems Inc	2 548 838	0,43
12 358	CAD Toronto-Dominion Bank	802 436	0,14	18 387	USD Capital One Financial Corp	2 410 903	0,41
Canada – Total				45 243	USD Carlyle Group Inc	1 840 938	0,31
				12 270	USD Caterpillar Inc	3 627 871	0,62
Irlande				11 096	USD Cboe Global Markets Inc	1 981 302	0,34
3 456	USD Accenture PLC	1 212 745	0,21	4 072	USD Cencora Inc	836 307	0,14
647	USD Medtronic PLC	53 300	0,01	25 150	USD Centene Corp	1 866 382	0,32
Irlande – Total				45 223	USD Charles Schwab Corp	3 111 342	0,53
				11 615	USD Cheniere Energy Inc	1 982 797	0,34
Jersey				12 465	USD Chevron Corp	1 859 279	0,32
11 820	USD Ferguson PLC	2 282 088	0,39	6 811	USD Cigna Group	2 039 554	0,35
Jersey – Total				39 753	USD Cisco Systems Inc	2 008 322	0,34
				13 766	USD Citigroup Inc	708 123	0,12
Suisse				58 970	USD Citizens Financial Group Inc	1 954 266	0,33
14 072	USD Garmin Ltd	1 808 815	0,31	12 822	USD CME Group Inc	2 700 313	0,46
14 798	USD TE Connectivity Ltd	2 079 119	0,35	24 315	USD Coca-Cola Co	1 432 883	0,24
Suisse – Total				6 309	USD Colgate-Palmolive Co	502 890	0,09
				92 725	USD Comcast Corp	4 065 991	0,69
Royaume-Uni				3 022	USD ConocoPhillips	350 764	0,06
2 206	USD Linde PLC	906 026	0,15	22 184	USD Consolidated Edison Inc	2 018 078	0,34
Royaume-Uni – Total				13 431	USD Constellation Energy Corp	1 569 950	0,27
				8 140	USD Costco Wholesale Corp	5 373 051	0,92
États-Unis				76 083	USD CSX Corp	2 637 798	0,45
38 707	USD Abbott Laboratories	4 260 479	0,73	1 630	USD Danaher Corp	377 084	0,06
25 571	USD AbbVie Inc	3 962 738	0,68	11 860	USD Darden Restaurants Inc	1 948 598	0,33
8 502	USD Adobe Inc	5 072 293	0,87	4 774	USD Datadog Inc	579 468	0,10
8 614	USD Advanced Micro Devices Inc	1 269 790	0,22	2 781	USD Deckers Outdoor Corp	1 858 904	0,32
3 298	USD AECOM	304 834	0,05	5 521	USD Dell Technologies Inc	422 357	0,07
14 010	USD Agilent Technologies Inc	1 947 810	0,33	12 535	USD Dick's Sporting Goods Inc	1 842 018	0,31
16 307	USD Akamai Technologies Inc	1 929 933	0,33				
67 480	USD Alphabet Inc	9 509 956	1,62				
75 594	USD Alphabet Inc	10 559 726	1,80				
2 296	USD Altria Group Inc	92 621	0,02				
125 579	USD Amazon.com Inc	19 080 473	3,26				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,49 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,49 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
20 197	USD DocuSign Inc	1 200 712	0,20	48 520	USD JPMorgan Chase & Co	8 253 252	1,41
39 542	USD Dow Inc	2 168 483	0,37	15 171	USD Kenvue Inc	326 632	0,06
60 762	USD Dropbox Inc	1 791 264	0,31	32 727	USD KeyCorp	471 269	0,08
15 494	USD Eastman Chemical Co	1 391 671	0,24	1 665	USD Kimberly-Clark Corp	202 314	0,03
7 289	USD Eaton Corp PLC	1 755 337	0,30	23 621	USD Kinder Morgan Inc	416 674	0,07
40 402	USD eBay Inc	1 762 335	0,30	3 959	USD KLA Corp	2 301 367	0,39
28 627	USD Edison International	2 046 544	0,35	2 161	USD Lam Research Corp	1 692 625	0,29
15 890	USD Electronic Arts Inc	2 173 911	0,37	3 341	USD Lear Corp	471 783	0,08
2 698	USD Elevance Health Inc	1 272 269	0,22	374	USD Lennar Corp	55 741	0,01
7 873	USD Eli Lilly & Co	4 589 329	0,78	2 220	USD Liberty Media Corp-Liberty Formula One	140 149	0,02
21 296	USD Emerson Electric Co	2 072 740	0,35	687	USD Lowe's Cos Inc	152 892	0,03
1 134	USD Entergy Corp	114 749	0,02	21 205	USD LyondellBasell Industries NV	2 016 171	0,34
55 534	USD Equitable Holdings Inc	1 849 282	0,32	11 660	USD M&T Bank Corp	1 598 353	0,27
7 450	USD Essex Property Trust Inc REIT	1 847 153	0,32	16 374	USD Marathon Petroleum Corp	2 429 247	0,41
22 276	USD Eversource Energy	1 374 875	0,23	11 101	USD Marriott International Inc	2 503 387	0,43
51 581	USD Exelon Corp	1 851 758	0,32	11 447	USD Marsh & McLennan Cos Inc	2 168 863	0,37
6 777	USD Expedia Group Inc	1 028 681	0,18	250	USD Martin Marietta Materials Inc	124 728	0,02
66 066	USD Exxon Mobil Corp	6 605 279	1,13	3 895	USD Masco Corp	260 887	0,04
10 439	USD F5 Inc	1 868 372	0,32	6 980	USD Mastercard Inc	2 977 040	0,51
1 648	USD Fair Isaac Corp	1 918 288	0,33	3 920	USD McDonald's Corp	1 162 319	0,20
9 350	USD FedEx Corp	2 365 269	0,40	988	USD McKesson Corp	457 424	0,08
2 032	USD Fidelity National Information Services Inc	122 062	0,02	49 088	USD Merck & Co Inc	5 351 574	0,91
45 141	USD Fifth Third Bancorp	1 556 913	0,27	33 252	USD Meta Platforms Inc	11 769 878	2,01
33	USD First Citizens BancShares Inc/NC	46 826	0,01	894	USD Mettler-Toledo International Inc	1 084 386	0,18
19 659	USD Fiserv Inc	2 611 502	0,45	88 409	USD Microsoft Corp	33 245 320	5,67
28 364	USD Ford Motor Co	345 757	0,06	29 025	USD Molson Coors Beverage Co	1 776 620	0,30
20 122	USD Fox Corp	556 373	0,09	42 516	USD Mondelez International Inc	3 079 434	0,53
62 404	USD Franklin Resources Inc	1 859 015	0,32	201	USD MSCI Inc	113 696	0,02
4 569	USD Gartner Inc	2 061 122	0,35	21 955	USD NetApp Inc	1 935 553	0,33
28 128	USD General Electric Co	3 589 977	0,61	7 165	USD Netflix Inc	3 488 495	0,60
64 121	USD General Motors Co	2 303 226	0,39	16 906	USD NextEra Energy Inc	1 026 870	0,18
38 110	USD Gilead Sciences Inc	3 087 291	0,53	5 799	USD NIKE Inc	629 597	0,11
17 861	USD GoDaddy Inc	1 896 124	0,32	9 781	USD Nucor Corp	1 702 285	0,29
25 608	USD Halliburton Co	925 729	0,16	35 573	USD Nvidia Corp	17 616 461	3,01
868	USD HCA Healthcare Inc	234 950	0,04	29 228	USD ONEOK Inc	2 052 390	0,35
7 961	USD HEICO Corp	1 423 984	0,24	34 100	USD Oracle Corp	3 595 163	0,61
1 033	USD HEICO Corp	147 141	0,03	10 700	USD Owens Corning	1 586 061	0,27
79 418	USD Hewlett Packard Enterprise Co	1 348 518	0,23	24 684	USD Paccar Inc	2 410 393	0,41
12 822	USD Hilton Worldwide Holdings Inc	2 334 758	0,40	11 693	USD Packaging Corp of America	1 904 907	0,32
4 316	USD Hologic Inc	308 378	0,05	3 319	USD Parker-Hannifin Corp	1 529 063	0,26
8 238	USD Home Depot Inc	2 854 879	0,49	34 784	USD PayPal Holdings Inc	2 136 085	0,36
39 151	USD Host Hotels & Resorts Inc REIT	762 270	0,13	26 324	USD PepsiCo Inc	4 470 868	0,76
37 552	USD Howmet Aerospace Inc	2 032 314	0,35	85 340	USD Pfizer Inc	2 456 939	0,42
9 844	USD HP Inc	296 206	0,05	23 693	USD Philip Morris International Inc	2 229 037	0,38
2 861	USD Humana Inc	1 309 794	0,22	18 594	USD Phillips 66	2 475 605	0,42
156 033	USD Huntington Bancshares Inc	1 984 740	0,34	128	USD Pool Corp	51 035	0,01
47 387	USD Intel Corp	2 381 197	0,41	13 850	USD PPG Industries Inc	2 071 268	0,35
11 691	USD International Business Machines Corp	1 912 063	0,33	42 836	USD Procter & Gamble Co	6 277 187	1,07
4 584	USD Intuit Inc	2 865 138	0,49	7 772	USD Prologis Inc REIT	1 036 008	0,18
28 952	USD Iron Mountain Inc REIT	2 026 061	0,35	21 436	USD Prudential Financial Inc	2 223 128	0,38
22 131	USD Johnson & Johnson	3 468 813	0,59	34 371	USD Public Service Enterprise Group Inc	2 101 787	0,36

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 98,49 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,49 % (suite)				
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)				
6 807	USD Public Storage REIT	2 076 135	0,35	12 034	USD T-Mobile US Inc	1 929 411	0,33	
6 489	USD PulteGroup Inc	669 795	0,11	2 366	USD TransDigm Group Inc	2 393 446	0,41	
26 827	USD Qualcomm Inc	3 879 989	0,66	641	USD Ulta Beauty Inc	314 084	0,05	
2 311	USD Quest Diagnostics Inc	318 641	0,05	9 836	USD Union Pacific Corp	2 415 918	0,41	
2 660	USD Regeneron Pharmaceuticals Inc	2 336 251	0,40	959	USD United Parcel Service Inc	150 784	0,03	
11 827	USD Republic Services Inc	1 950 391	0,33	1 090	USD United Rentals Inc	625 028	0,11	
1 202	USD Ross Stores Inc	166 345	0,03	13 813	USD UnitedHealth Group Inc	7 272 130	1,24	
2 911	USD RPM International Inc	324 955	0,06	15 796	USD Valero Energy Corp	2 053 480	0,35	
289	USD S&P Global Inc	127 310	0,02	8 874	USD Ventas Inc REIT	442 280	0,08	
15 040	USD Salesforce Inc	3 957 626	0,68	101 037	USD Verizon Communications Inc	3 809 095	0,65	
28 346	USD SEI Investments Co	1 801 388	0,31	997	USD Vertex Pharmaceuticals Inc	405 669	0,07	
211	USD ServiceNow Inc	149 069	0,03	179 255	USD Viatris Inc	1 941 332	0,33	
1 111	USD Sherwin-Williams Co	346 521	0,06	27 755	USD Visa Inc	7 226 014	1,23	
14 423	USD Simon Property Group Inc REIT	2 057 297	0,35	532	USD Vulcan Materials Co	120 769	0,02	
17 951	USD Skyworks Solutions Inc	2 018 051	0,34	6 514	USD Walt Disney Co	588 149	0,10	
6 708	USD Snap-on Inc	1 937 539	0,33	14 269	USD Waste Management Inc	2 555 578	0,44	
31 082	USD SS&C Technologies Holdings Inc	1 899 421	0,32	5 490	USD West Pharmaceutical Services Inc	1 933 139	0,33	
920	USD Starbucks Corp	88 329	0,02	7 960	USD Westinghouse Air Brake Technologies Corp	1 010 124	0,17	
12 845	USD Steel Dynamics Inc	1 516 995	0,26	57 429	USD Weyerhaeuser Co REIT	1 996 806	0,34	
8 822	USD Styer Plc	1 939 517	0,33	4 885	USD Yum! Brands Inc	638 274	0,11	
10 416	USD Stryker Corp	3 119 175	0,53	15 274	USD Zimmer Biomet Holdings Inc	1 858 846	0,32	
4 882	USD Synopsys Inc	2 513 791	0,43	États-Unis – Total			541 792 582	92,44
27 549	USD Sysco Corp	2 014 658	0,34	Total des actions ordinaires et préférentielles			577 267 587	98,49
19 068	USD T Rowe Price Group Inc	2 053 433	0,35	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			577 267 587	98,49
21 882	USD Targa Resources Corp	1 900 889	0,32	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			577 267 587	98,49
30 746	USD Tesla Inc	7 639 766	1,30					
1 585	USD Texas Instruments Inc	270 179	0,05					
3 932	USD Thermo Fisher Scientific Inc	2 087 066	0,36					
34 002	USD TJX Cos Inc	3 189 728	0,54					

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,04 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
S&P EMINI INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	33	7 953 000	223 629	0,04
S&P/TSX 60 INDEX FUTURE, due 14/03/24	CAD	2	385 378	13 081	0,00
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			8 338 378	236 710	0,04
Total des contrats à terme standardisés			8 338 378	236 710	0,04
Autres actifs/(passifs) nets				8 604 118	1,47
TOTAL DES ACTIFS NETS				586 108 415	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 152 299 USD détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 %				Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (<i>suite</i>)			
Argentine				Canada (<i>suite</i>)			
38	USD MercadoLibre Inc	59 719	0,07	706	CAD Magna International Inc	41 918	0,05
Argentine – Total				Canada – Total			
59 719 0,07				2 678 490 3,09			
Australie				Danemark			
4 249	AUD Ampol Ltd	104 810	0,12	97	DKK Carlsberg AS	12 172	0,01
5 090	AUD ANZ Group Holdings Ltd	90 024	0,10	2 337	DKK Demant A/S	102 507	0,12
555	AUD Aristocrat Leisure Ltd	15 459	0,02	4 016	DKK Novo Nordisk A/S	415 445	0,48
361	USD Atlassian Corp	85 867	0,10	797	DKK Pandora A/S	110 213	0,13
29 906	AUD Aurizon Holdings Ltd	77 544	0,09	Danemark – Total			
7 301	AUD BHP Group Ltd	251 134	0,29	640 337 0,74			
6 566	AUD BlueScope Steel Ltd	104 839	0,12	Finlande			
13 865	AUD Brambles Ltd	128 667	0,15	12 782	SEK Nordea Bank Abp	158 186	0,18
2 396	AUD Coles Group Ltd	26 338	0,03	1 618	EUR Sampo Oyj	70 796	0,08
954	AUD Commonwealth Bank of Australia	72 778	0,08	4 085	EUR Wartsila OYJ Abp	59 226	0,07
160	AUD CSL Ltd	31 295	0,04	Finlande – Total			
8 034	AUD Fortescue Ltd	159 088	0,18	288 208 0,33			
3 084	AUD Goodman Group REIT	53 240	0,06	France			
19 355	AUD GPT Group REIT	61 280	0,07	216	EUR Air Liquide SA	42 023	0,05
6 112	AUD National Australia Bank Ltd	128 035	0,15	558	EUR Arkema SA	63 489	0,07
38 024	AUD Scentre Group REIT	77 578	0,09	2 932	EUR BNP Paribas SA	202 719	0,23
32 234	AUD Stockland REIT	97 877	0,11	5 363	EUR Carrefour SA	98 135	0,11
66 284	AUD Vicinity Ltd REIT	92 267	0,11	2 054	EUR Cie de Saint-Gobain SA	151 248	0,18
842	AUD Woolworths Group Ltd	21 373	0,03	511	EUR Dassault Aviation SA	101 154	0,12
Australie – Total				France – Total			
1 679 493 1,94				2 519 688 2,91			
Autriche				Allemagne			
2 371	EUR Erste Group Bank AG	96 200	0,11	832	EUR Allianz SE	222 369	0,26
Autriche – Total				1 364			
96 200 0,11				EUR Bayerische Motoren Werke AG			
Belgique				151 849 0,17			
1 384	EUR KBC Group NV	89 773	0,11	444			
852	EUR Syensqo SA	88 714	0,10	EUR Beiersdorf AG			
Belgique – Total				66 556 0,08			
178 487 0,21							
Bermudes							
313	USD Everest Group Ltd	110 671	0,13				
Bermudes – Total							
110 671 0,13							
Canada							
1 706	CAD Alimentation Couche-Tard Inc	100 955	0,12				
3 482	CAD AltaGas Ltd	73 464	0,08				
7 268	CAD ARC Resources Ltd	108 419	0,13				
1 186	CAD BRP Inc	85 285	0,10				
423	CAD CAE Inc	9 175	0,01				
386	CAD Canadian Apartment Properties REIT	14 285	0,02				
638	CAD Canadian National Railway Co	80 585	0,09				
303	CAD CGI Inc	32 618	0,04				
3 301	CAD Empire Co Ltd	87 745	0,10				
1 153	CAD Gildan Activewear Inc	38 317	0,04				
3 213	CAD Great-West Lifeco Inc	106 873	0,12				
1 431	CAD iA Financial Corp Inc	98 030	0,11				
886	CAD Imperial Oil Ltd	50 717	0,06				
16 848	CAD Kinross Gold Corp	102 473	0,12				
1 308	CAD Loblaw Cos Ltd	127 249	0,15				
301	USD Lululemon Athletica Inc	153 898	0,18				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)			
Allemagne (suite)				Japon (suite)			
8 861	EUR Commerzbank AG	105 322	0,12	1 900	JPY Hulic Co Ltd	19 899	0,02
10 301	EUR Deutsche Bank AG	140 690	0,16	8 600	JPY Inpex Corp	116 177	0,13
3 574	EUR Deutsche Lufthansa AG	31 774	0,04	6 500	JPY Japan Post Holdings Co Ltd	58 070	0,07
3 334	EUR Deutsche Post AG	165 197	0,19	5 400	JPY Japan Post Insurance Co Ltd	95 911	0,11
8 893	EUR Deutsche Telekom AG	213 664	0,25	4 800	JPY Japan Tobacco Inc	124 103	0,14
4 215	EUR EON SE	56 571	0,06	5 800	JPY Kajima Corp	96 948	0,11
1 369	EUR Heidelberg Materials AG	122 403	0,14	7 500	JPY Kansai Electric Power Co Inc	99 589	0,12
381	EUR MTU Aero Engines AG	82 175	0,09	5 200	JPY Komatsu Ltd	136 031	0,16
1 967	EUR SAP SE	303 069	0,35	400	JPY Konami Group Corp	20 948	0,02
1 596	EUR Siemens AG	299 573	0,35	5 600	JPY Marubeni Corp	88 520	0,10
Allemagne – Total		1 961 212	2,26	2 400	JPY MatsukiyoCocokara & Co	42 508	0,05
Hong Kong				8 900	JPY Mazda Motor Corp	96 178	0,11
5 195	HKD AIA Group Ltd	45 273	0,05	4 000	JPY Mitsubishi Chemical Group Corp	24 514	0,03
4 000	HKD CK Asset Holdings Ltd	20 081	0,02	6 600	JPY Mitsubishi Corp	105 498	0,12
20 493	HKD CK Hutchison Holdings Ltd	109 832	0,13	5 108	JPY Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	43 895	0,05
13 500	HKD Swire Pacific Ltd	114 279	0,13	4 500	JPY Mitsui & Co Ltd	169 109	0,20
153 000	HKD WH Group Ltd	98 753	0,12	3 400	JPY Mitsui Chemicals Inc	100 857	0,12
Hong-Kong – Total		388 218	0,45	1 900	JPY Mitsui Fudosan Co Ltd	46 604	0,05
Irlande				2 000	JPY MS&AD Insurance Group Holdings Inc	78 678	0,09
627	USD Accenture PLC	220 021	0,26	2 145	JPY NEC Corp	127 045	0,15
3 917	EUR AIB Group PLC	16 788	0,02	900	JPY Nintendo Co Ltd	46 979	0,05
907	GBP CRH PLC	62 553	0,07	3 300	JPY Nippon Steel Corp	75 606	0,09
3 130	USD Medtronic PLC	257 849	0,30	2 494	JPY Nippon Yusen KK	77 325	0,09
2 021	EUR Smurfit Kappa Group PLC	80 102	0,09	1 391	JPY Nitto Denko Corp	104 093	0,12
723	USD Trane Technologies PLC	176 340	0,20	24 800	JPY Nomura Holdings Inc	112 179	0,13
565	USD Willis Towers Watson PLC	136 278	0,16	3 670	JPY Nomura Real Estate Holdings Inc	96 553	0,11
Irlande – Total		949 931	1,10	6 900	JPY ORIX Corp	129 993	0,15
Israël				3 300	JPY Otsuka Holdings Co Ltd	123 803	0,14
100	USD Check Point Software Technologies Ltd	15 279	0,02	7 800	JPY Renesas Electronics Corp	141 029	0,16
900	USD Wix.com Ltd	110 718	0,13	300	JPY Secom Co Ltd	21 609	0,03
Israël – Total		125 997	0,15	5 100	JPY Shin-Etsu Chemical Co Ltd	214 050	0,25
Italie				4 500	JPY Softbank Corp	56 162	0,07
23 564	EUR Enel SpA	175 182	0,20	698	JPY Sony Group Corp	66 394	0,08
1 326	EUR Eni SpA	22 481	0,02	6 000	JPY Subaru Corp	110 058	0,13
56 052	EUR Intesa Sanpaolo SpA	163 680	0,19	5 100	JPY Sumitomo Corp	111 275	0,13
5 970	EUR UniCredit SpA	162 000	0,19	1 086	JPY Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	52 998	0,06
Italie – Total		523 343	0,60	100	JPY Tokyo Electron Ltdi	17 914	0,02
Japon				4 500	JPY Tokyo Gas Co Ltd	103 355	0,12
1 400	JPY Aisin Corp	48 987	0,06	20 505	JPY Toyota Motor Corp	376 778	0,43
2 100	JPY Asahi Group Holdings Ltd	78 322	0,09	2 500	JPY Yokogawa Electric Corp	47 684	0,06
1 900	JPY Bridgestone Corp	78 706	0,09	Japon – Total		4 941 015	5,70
2 800	JPY Canon Inc	71 897	0,08	Jersey			
7 500	JPY Chubu Electric Power Co Inc	96 902	0,11	847	USD Ferguson PLC	163 530	0,19
400	JPY Dai Nippon Printing Co Ltd	11 840	0,01	Jersey – Total		163 530	0,19
3 800	JPY Daiwa House Industry Co Ltd	115 148	0,13	Jordanie			
15 800	JPY Daiwa Securities Group Inc	106 368	0,12	3 236	GBP Hikma Pharmaceuticals PLC	73 801	0,08
8 500	JPY Denso Corp	128 242	0,15	Jordanie – Total		73 801	0,08
14 400	JPY ENEOS Holdings Inc	57 240	0,07				
2 800	JPY Hitachi Ltd	201 986	0,23				
16 200	JPY Honda Motor Co Ltd	168 458	0,19				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)			
Pays-Bas				Suisse (suite)			
437	EUR ASML Holding NV	329 078	0,38	162	USD Chubb Ltd	36 612	0,04
734	EUR EXOR NV	73 379	0,09	3 558	GBP Coca-Cola HBC AG	104 549	0,12
11 910	EUR ING Groep NV	177 953	0,21	483	USD Garmin Ltd	62 085	0,07
1 643	EUR Koninklijke Philips NV	38 268	0,04	2 109	CHF Holcim AG	165 432	0,19
2 319	EUR NN Group NV	91 580	0,11	270	CHF Kuehne & Nagel International AG	92 967	0,11
767	USD NXP Semiconductors NV	176 165	0,20	699	CHF Logitech International SA	66 242	0,08
7 486	EUR Stellantis NV	174 898	0,20	2 957	CHF Nestle SA	342 585	0,40
1 054	EUR Wolters Kluwer NV	149 846	0,17	3 841	CHF Novartis AG	387 317	0,45
Pays-Bas – Total		1 211 167	1,40	8	CHF Partners Group Holding AG	11 530	0,01
Nouvelle-Zélande				774	CHF Roche Holding AG	224 848	0,26
12 964	NZD Spark New Zealand Ltd	42 518	0,05	963	CHF Sandoz Group AG	30 962	0,04
Nouvelle-Zélande – Total		42 518	0,05	2 832	EUR STMicroelectronics NV	141 543	0,16
Norvège				176	CHF Swiss Life Holding AG	122 122	0,14
1 281	NOK Equinor ASA	40 634	0,05	1 148	USD TE Connectivity Ltd	161 294	0,19
2 375	NOK Kongsberg Gruppen ASA	108 838	0,12	405	CHF Zurich Insurance Group AG	211 535	0,24
6 215	NOK Telenor ASA	71 356	0,08	Suisse – Total		2 644 826	3,05
Norvège – Total		220 828	0,25	Royaume-Uni			
Singapour				4 584	GBP 3i Group PLC	141 476	0,16
30 000	SGD CapitaLand Ascendas REIT	68 911	0,08	536	USD Aon PLC	155 987	0,18
2 400	SGD Jardine Cycle & Carriage Ltd	54 146	0,06	3 532	GBP Associated British Foods PLC	106 576	0,12
15 600	SGD Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	153 741	0,18	1 674	GBP Astrazeneca PLC	226 206	0,26
3 200	SGD Singapore Airlines Ltd	15 914	0,02	67 651	GBP Barclays PLC	132 622	0,15
33 200	SGD Singapore Technologies Engineering Ltd	97 906	0,11	6 359	GBP BP PLC	37 788	0,04
Singapour – Total		390 618	0,45	20 403	GBP BT Group PLC	32 148	0,04
Espagne				57 274	GBP Centrica PLC	102 693	0,12
2 090	EUR ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	92 718	0,10	1 900	USD Coca-Cola Europacific Partners PLC	126 806	0,15
18 915	EUR Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	171 878	0,20	3 932	GBP Diageo PLC	143 157	0,16
42 350	EUR Banco Santander SA	176 813	0,20	11 133	GBP GSK PLC	205 817	0,24
16 393	EUR Iberdrola SA	214 948	0,25	39 815	GBP HSBC Holdings PLC	322 555	0,37
6 028	EUR Telefonica SA	23 532	0,03	1 427	GBP InterContinental Hotels Group PLC	128 977	0,15
Espagne – Total		679 889	0,78	26 802	GBP J Sainsbury PLC	103 390	0,12
Suède				452	USD Linde PLC	185 641	0,21
1 481	SEK Getinge AB	32 962	0,04	85 252	GBP Lloyds Banking Group PLC	51 851	0,06
3 854	SEK H & M Hennes & Mauritz AB	67 544	0,08	35 273	GBP M&G PLC	100 004	0,12
3 068	SEK Industrivarden AB	99 945	0,11	14 066	GBP Melrose Industries PLC	101 742	0,12
1 724	SEK Saab AB	103 941	0,12	6 513	GBP NatWest Group PLC	18 216	0,02
9 796	SEK Skandinaviska Enskilda Banken AB	134 918	0,16	1 050	GBP Next PLC	108 663	0,13
5 086	SEK SKF AB	101 590	0,12	910	AUD Rio Tinto Ltd	84 237	0,10
4 794	SEK Swedbank AB	96 709	0,11	2 185	GBP Rio Tinto PLC	162 725	0,19
2 167	SEK Volvo AB	56 272	0,06	39 134	GBP Rolls-Royce Holdings PLC	149 514	0,17
Suède – Total		693 881	0,80	3 054	GBP Sage Group PLC	45 648	0,05
Suisse				11 862	GBP Shell PLC	388 854	0,45
4 662	CHF ABB Ltd	206 609	0,24	36 508	GBP Tesco PLC	135 200	0,16
2 196	CHF Adecco Group AG	107 680	0,12	1 708	GBP Unilever PLC	82 740	0,10
546	CHF BKW AG	96 984	0,11	2 493	GBP Whitbread PLC	116 191	0,13
6	CHF Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG	71 930	0,08	Royaume-Uni – Total		3 697 424	4,27
				États-Unis			
				3 364	USD Abbott Laboratories	370 275	0,43
				2 476	USD AbbVie Inc	383 706	0,44
				785	USD Adobe Inc	468 331	0,54

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
1 978	USD Advanced Micro Devices Inc	291 577	0,34	280	USD Cintas Corp	168 745	0,19
1 058	USD Agilent Technologies Inc	147 094	0,17	7 549	USD Cisco Systems Inc	381 375	0,44
1 047	USD Akamai Technologies Inc	123 912	0,14	673	USD Citigroup Inc	34 619	0,04
272	USD Align Technology Inc	74 528	0,09	3 881	USD Citizens Financial Group Inc	128 616	0,15
7 728	USD Alphabet Inc	1 089 107	1,26	991	USD CME Group Inc	208 705	0,24
8 731	USD Alphabet Inc	1 219 633	1,41	4 213	USD Coca-Cola Co	248 272	0,29
577	USD Altria Group Inc	23 276	0,03	631	USD Colgate-Palmolive Co	50 297	0,06
13 613	USD Amazon.com Inc	2 068 359	2,39	8 035	USD Comcast Corp	352 335	0,41
317	USD American Express Co	59 387	0,07	1 904	USD ConocoPhillips	220 997	0,25
2 517	USD American International Group Inc	170 527	0,20	1 607	USD Consolidated Edison Inc	146 189	0,17
204	USD American Tower Corp REIT	44 040	0,05	149	USD Cooper Cos Inc	56 388	0,06
435	USD Ameriprise Financial Inc	165 226	0,19	391	USD Corning Inc	11 906	0,01
939	USD AMETEK Inc	154 832	0,18	761	USD Costco Wholesale Corp	502 321	0,58
1 082	USD Amgen Inc	311 638	0,36	953	USD Crown Castle Inc REIT	109 776	0,13
1 910	USD Amphenol Corp	189 338	0,22	5 714	USD CSX Corp	198 104	0,23
200	USD Analog Devices Inc	39 712	0,05	349	USD Cummins Inc	83 610	0,10
21 700	USD Apple Inc	4 177 901	4,82	858	USD CVS Health Corp	67 748	0,08
1 769	USD Applied Materials Inc	286 702	0,33	590	USD Danaher Corp	136 491	0,16
2 037	USD Archer-Daniels-Midland Co	147 112	0,17	754	USD Darden Restaurants Inc	123 882	0,14
6 610	USD AT&T Inc	110 916	0,13	666	USD Datadog Inc	80 839	0,09
989	USD Automatic Data Processing Inc	230 407	0,27	181	USD Deckers Outdoor Corp	120 986	0,14
60	USD AutoZone Inc	155 137	0,18	414	USD Deere & Co	165 546	0,19
77	USD AvalonBay Communities Inc REIT	14 416	0,02	663	USD Dell Technologies Inc	50 720	0,06
515	USD Axon Enterprise Inc	133 040	0,15	492	USD Dick's Sporting Goods Inc	72 299	0,08
1 137	USD Baker Hughes Co	38 863	0,04	1 932	USD DocuSign Inc	114 857	0,13
12 911	USD Bank of America Corp	434 713	0,50	570	USD DoorDash Inc	56 367	0,06
672	USD Becton Dickinson and Co	163 854	0,19	2 740	USD Dow Inc	150 262	0,17
1 589	USD Berkshire Hathaway Inc	566 733	0,65	1 180	USD DR Horton Inc	179 336	0,21
180	USD BlackRock Inc	146 124	0,17	3 411	USD Dropbox Inc	100 556	0,12
1 584	USD Blackstone Inc	207 377	0,24	1 202	USD Eastman Chemical Co	107 964	0,12
79	USD Booking Holdings Inc	280 230	0,32	982	USD Eaton Corp PLC	236 485	0,27
652	USD Boston Scientific Corp	37 692	0,04	2 916	USD eBay Inc	127 196	0,15
4 522	USD Bristol-Myers Squibb Co	232 024	0,27	1 901	USD Edison International	135 903	0,16
704	USD Broadcom Inc	785 840	0,91	208	USD Edwards Lifesciences Corp	15 860	0,02
718	USD Broadridge Financial Solutions Inc	147 729	0,17	1 059	USD Electronic Arts Inc	144 882	0,17
841	USD Builders FirstSource Inc	140 397	0,16	386	USD Elevance Health Inc	182 022	0,21
1 010	USD Bunge Global SA	101 960	0,12	974	USD Eli Lilly & Co	567 764	0,65
756	USD Cadence Design Systems Inc	205 912	0,24	1 846	USD Emerson Electric Co	179 671	0,21
228	USD Campbell Soup Co	9 856	0,01	395	USD EOG Resources Inc	47 775	0,05
1 360	USD Capital One Financial Corp	178 323	0,21	3 227	USD Equitable Holdings Inc	107 459	0,12
702	USD Cardinal Health Inc	70 762	0,08	521	USD Essex Property Trust Inc REIT	129 177	0,15
2 703	USD Carlyle Group Inc	109 985	0,13	1 218	USD Eversource Energy	75 175	0,09
1 067	USD Caterpillar Inc	315 480	0,36	575	USD Exact Sciences Corp	42 539	0,05
716	USD Cboe Global Markets Inc	127 849	0,15	3 933	USD Exelon Corp	141 195	0,16
432	USD Centora Inc	88 724	0,10	888	USD Expedia Group Inc	134 790	0,16
2 079	USD Centene Corp	154 283	0,18	6 377	USD Exxon Mobil Corp	637 572	0,74
3 668	USD Charles Schwab Corp	252 358	0,29	358	USD F5 Inc	64 075	0,07
191	USD Charter Communications Inc	74 238	0,09	72	USD Fair Isaac Corp	83 809	0,10
867	USD Cheniere Energy Inc	148 006	0,17	738	USD FedEx Corp	186 692	0,22
1 932	USD Chevron Corp	288 177	0,33	192	USD Fidelity National Information Services Inc	11 533	0,01
1 379	USD Church & Dwight Co Inc	130 398	0,15	4 141	USD Fifth Third Bancorp	142 823	0,16
580	USD Cigna Group	173 681	0,20	363	USD Fiserv Inc	48 221	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
89	USD FleetCor Technologies Inc	25 152	0,03	1 265	USD Marathon Petroleum Corp	187 675	0,22
1 213	USD Fortune Brands Innovations Inc	92 358	0,11	805	USD Marriott International Inc	181 536	0,21
3 108	USD Fox Corp	85 936	0,10	1 202	USD Marsh & McLennan Cos Inc	227 743	0,26
3 800	USD Franklin Resources Inc	113 202	0,13	827	USD Marvell Technology Inc	49 876	0,06
316	USD Gartner Inc	142 551	0,16	432	USD Masco Corp	28 935	0,03
2 377	USD General Electric Co	303 377	0,35	968	USD Mastercard Inc	412 862	0,48
1 020	USD General Motors Co	36 638	0,04	680	USD Match Group Inc	24 820	0,03
2 995	USD Gilead Sciences Inc	242 625	0,28	719	USD McDonald's Corp	213 191	0,25
1 164	USD GoDaddy Inc	123 570	0,14	360	USD McKesson Corp	166 673	0,19
213	USD Goldman Sachs Group Inc	82 169	0,09	4 224	USD Merck & Co Inc	460 500	0,53
2 322	USD Halliburton Co	83 940	0,10	3 362	USD Meta Platforms Inc	1 190 014	1,37
200	USD Hartford Financial Services Group Inc	16 076	0,02	90	USD Mettler-Toledo International Inc	109 166	0,13
130	USD HCA Healthcare Inc	35 188	0,04	668	USD Microchip Technology Inc	60 240	0,07
564	USD HEICO Corp	100 883	0,12	488	USD Micron Technology Inc	41 646	0,05
94	USD HEICO Corp	13 389	0,02	9 858	USD Microsoft Corp	3 707 002	4,28
260	USD Hershey Co	48 474	0,06	518	USD Moderna Inc	51 515	0,06
7 823	USD Hewlett Packard Enterprise Co	132 835	0,15	1 698	USD Molson Coors Beverage Co	103 935	0,12
947	USD Hilton Worldwide Holdings Inc	172 439	0,20	3 218	USD Mondelez International Inc	233 080	0,27
1 444	USD Hologic Inc	103 174	0,12	1 654	USD Morgan Stanley	154 236	0,18
1 682	USD Home Depot Inc	582 897	0,67	286	USD MSCI Inc	161 776	0,19
4 934	USD Host Hotels & Resorts Inc REIT	96 065	0,11	1 503	USD NetApp Inc	132 504	0,15
2 456	USD Howmet Aerospace Inc	132 919	0,15	797	USD Netflix Inc	388 043	0,45
65	USD Hubbell Inc	21 380	0,02	3 302	USD NextEra Energy Inc	200 563	0,23
232	USD Humana Inc	106 212	0,12	1 474	USD NIKE Inc	160 032	0,18
273	USD IDEXX Laboratories Inc	151 529	0,17	957	USD Nucor Corp	166 556	0,19
136	USD Illinois Tool Works Inc	35 624	0,04	3 599	USD Nvidia Corp	1 782 297	2,06
1 114	USD Incyte Corp	69 948	0,08	2 238	USD ONEOK Inc	157 152	0,18
245	USD Insulet Corp	53 160	0,06	3 319	USD Oracle Corp	349 922	0,40
7 873	USD Intel Corp	395 618	0,46	655	USD Otis Worldwide Corp	58 603	0,07
1 240	USD International Business Machines Corp	202 802	0,23	527	USD Owens Corning	78 117	0,09
553	USD Intuit Inc	345 642	0,40	1 707	USD Paccar Inc	166 689	0,19
420	USD Intuitive Surgical Inc	141 691	0,16	683	USD Packaging Corp of America	111 268	0,13
205	USD IQVIA Holdings Inc	47 433	0,05	111	USD Palo Alto Networks Inc	32 732	0,04
1 931	USD Iron Mountain Inc REIT	135 131	0,16	413	USD Parker-Hannifin Corp	190 269	0,22
2 840	USD Johnson & Johnson	445 142	0,51	272	USD Paychex Inc	32 398	0,04
4 560	USD JPMorgan Chase & Co	775 656	0,89	2 902	USD PayPal Holdings Inc	178 212	0,21
832	USD Juniper Networks Inc	24 527	0,03	2 172	USD PepsiCo Inc	368 892	0,43
1 984	USD Kenvue Inc	42 716	0,05	8 448	USD Pfizer Inc	243 218	0,28
890	USD Keurig Dr Pepper Inc	29 655	0,03	2 564	USD Philip Morris International Inc	241 221	0,28
849	USD Keysight Technologies Inc	135 067	0,16	1 436	USD Phillips 66	191 189	0,22
1 263	USD Kimberly-Clark Corp	153 467	0,18	1 003	USD PPG Industries Inc	149 999	0,17
7 960	USD Kinder Morgan Inc	140 414	0,16	3 964	USD Procter & Gamble Co	580 885	0,67
361	USD KLA Corp	209 849	0,24	236	USD Progressive Corp	37 590	0,04
1 205	USD Kroger Co	55 081	0,06	532	USD Prologis Inc REIT	70 916	0,08
235	USD Lam Research Corp	184 066	0,21	1 575	USD Prudential Financial Inc	163 343	0,19
1 007	USD Lennar Corp	150 083	0,17	2 201	USD Public Service Enterprise Group Inc	134 591	0,15
203	USD Liberty Media Corp-Liberty Formula One	12 815	0,01	542	USD Public Storage REIT	165 310	0,19
668	USD Lowe's Cos Inc	148 663	0,17	1 286	USD PulteGroup Inc	132 741	0,15
1 343	USD LyondellBasell Industries NV	127 692	0,15	2 368	USD Qualcomm Inc	342 484	0,39
735	USD Marathon Oil Corp	17 758	0,02	253	USD Regeneron Pharmaceuticals Inc	222 207	0,26
				320	USD Reliance Steel & Aluminum Co	89 498	0,10
				976	USD Roblox Corp	44 623	0,05

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,37 % (suite)				
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)				
348 USD	Roku Inc	31 898	0,04	2 301 USD	Uber Technologies Inc	141 673	0,16	
120 USD	Ross Stores Inc	16 607	0,02	1 263 USD	Union Pacific Corp	310 218	0,36	
970 USD	RPM International Inc	108 281	0,12	363 USD	United Parcel Service Inc	57 075	0,07	
227 USD	S&P Global Inc	99 998	0,12	181 USD	United Rentals Inc	103 789	0,12	
1 737 USD	Salesforce Inc	457 074	0,53	1 322 USD	UnitedHealth Group Inc	695 993	0,80	
1 617 USD	SEI Investments Co	102 760	0,12	1 205 USD	Valero Energy Corp	156 650	0,18	
1 077 USD	Sempra	80 484	0,09	66 USD	Veeva Systems Inc	12 706	0,01	
349 USD	ServiceNow Inc	246 565	0,28	641 USD	Ventas Inc REIT	31 947	0,04	
495 USD	Sherwin-Williams Co	154 391	0,18	8 690 USD	Verizon Communications Inc	327 613	0,38	
1 137 USD	Simon Property Group Inc REIT	162 182	0,19	575 USD	Vertex Pharmaceuticals Inc	233 962	0,27	
1 102 USD	Skyworks Solutions Inc	123 887	0,14	10 176 USD	Viatis Inc	110 206	0,13	
379 USD	Snap-on Inc	109 470	0,13	2 618 USD	Visa Inc	681 596	0,79	
86 USD	Snowflake Inc	17 114	0,02	1 021 USD	W R Berkley Corp	72 205	0,08	
1 801 USD	SS&C Technologies Holdings Inc	110 059	0,13	1 543 USD	Walt Disney Co	139 317	0,16	
1 673 USD	Starbucks Corp	160 625	0,19	886 USD	Waste Management Inc	158 683	0,18	
1 055 USD	Steel Dynamics Inc	124 596	0,14	343 USD	West Pharmaceutical Services Inc	120 777	0,14	
576 USD	Steris Plc	126 634	0,15	1 087 USD	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	137 940	0,16	
815 USD	Stryker Corp	244 060	0,28	4 031 USD	Weyerhaeuser Co REIT	140 158	0,16	
397 USD	Synopsys Inc	204 419	0,24	109 USD	Workday Inc	30 091	0,03	
2 036 USD	Sysco Corp	148 893	0,17	732 USD	Yum! Brands Inc	95 643	0,11	
1 263 USD	T Rowe Price Group Inc	136 012	0,16	82 USD	Zimmer Biomet Holdings Inc	9 979	0,01	
1 262 USD	Targa Resources Corp	109 630	0,13	174 USD	Zoetis Inc	34 342	0,04	
494 USD	Target Corp	70 355	0,08	1 105 USD	Zoom Video Communications Inc	79 461	0,09	
3 628 USD	Tesla Inc	901 485	1,04	États-Unis – Total			57 432 249	66,26
629 USD	Texas Instruments Inc	107 219	0,12	Total des actions ordinaires et préférentielles			84 391 740	97,37
559 USD	Thermo Fisher Scientific Inc	296 712	0,34	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				
2 670 USD	TJX Cos Inc	250 473	0,29	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			84 391 740	97,37
1 370 USD	T-Mobile US Inc	219 652	0,25					
174 USD	TransDigm Group Inc	176 018	0,20					
584 USD	Trimble Inc	31 069	0,04					
422 USD	Twilio Inc	32 017	0,04					

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,01 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
MSCI EAFE INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	5	563 100	3 600	0,00
S&P EMINI INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	6	1 446 000	6 950	0,01
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			2 009 100	10 550	0,01
Total des contrats à terme standardisés			2 009 100	10 550	0,01
Autres actifs/(passifs) nets				2 274 564	2,62
TOTAL DES ACTIFS NETS				86 676 854	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 68 688 USD détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 %				Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)			
Belgique				Chine			
6 575 EUR	Titan Cement International SA	155 793	0,02	2 150 000 HKD	3SBio Inc	2 070 551	0,24
Belgique – Total				2 142 872 HKD	Alibaba Group Holding Ltd	20 746 633	2,40
Brésil				1 844 000 HKD	Aluminum Corp of China Ltd	920 990	0,11
857 400 BRL	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	2 568 176	0,30	150 000 CNY	Aluminum Corp of China Ltd	118 810	0,01
142 999 BRL	Banco Bradesco SA	449 816	0,05	164 200 HKD	ANTA Sports Products Ltd	1 592 889	0,18
647 749 USD	Banco Bradesco SA–ADR	2 267 121	0,26	109 100 USD	Autohome Inc–ADR	3 061 346	0,36
545 044 BRL	Banco Bradesco SA–Preferred Stock	1 917 573	0,22	3 938 215 HKD	Bank of China Ltd	1 502 953	0,17
283 900 BRL	Banco do Brasil SA	3 237 241	0,38	411 000 HKD	Bank of Communications Co Ltd	256 331	0,03
186 500 BRL	Banco Santander Brasil SA	1 240 108	0,14	1 127 800 CNY	Beijing Capital Eco-Environment Protection Group Co Ltd	426 057	0,05
58 600 BRL	Cia De Sanena Do Parana	352 136	0,04	81 000 CNY	Beijing Easpring Material Technology Co Ltd	434 542	0,05
932 980 BRL	Cia Energetica de Minas Gerais–Preferred Stock	2 204 918	0,26	1 138 000 HKD	Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd	252 126	0,03
242 700 BRL	CPFL Energia SA	1 924 073	0,22	1 168 100 CNY	Beijing SPC Environment Protection Tech Co Ltd	812 024	0,09
949 400 BRL	CSN Mineracao SA	1 530 345	0,18	104 240 HKD	Bilibili Inc	1 249 510	0,15
430 645 BRL	Gerdau SA–Preferred Stock	2 106 416	0,24	148 500 HKD	BYD Co Ltd	4 077 377	0,47
56 200 BRL	Itau Unibanco Holding SA	333 664	0,04	85 500 HKD	BYD Electronic International Co Ltd	400 753	0,05
831 920 USD	Itau Unibanco Holding SA–ADR	5 781 844	0,67	840 900 CNY	CECEP Solar Energy Co Ltd	658 964	0,08
479 100 BRL	Klabin SA	2 191 535	0,25	9 398 000 HKD	CGN Power Co Ltd	2 455 247	0,28
34 709 BRL	Marfrig Global Foods SA	69 309	0,01	3 541 700 CNY	CGN Power Co Ltd	1 546 876	0,18
34 218 USD	Nexa Resources SA	244 316	0,03	127 800 CNY	ChangYuan Technology Group Ltd	96 021	0,01
410 800 BRL	Petroleo Brasileiro SA	3 296 480	0,38	1 017 300 CNY	Chengdu Xingrong Environment Co Ltd	812 914	0,09
825 900 BRL	Petroleo Brasileiro SA–Preferred Stock	6 331 628	0,73	214 800 CNY	Chengxin Lithium Group Co Ltd	686 276	0,08
19 800 BRL	Sao Martinho S/A	119 470	0,01	262 000 HKD	China Communications Services Corp Ltd	108 712	0,01
283 100 BRL	Suzano SA	3 242 106	0,38	2 386 000 HKD	China Conch Venture Holdings Ltd	1 980 045	0,23
230 500 BRL	Telefonica Brasil SA	2 535 804	0,29	9 987 430 HKD	China Construction Bank Corp	5 947 525	0,69
482 109 BRL	TIM SA	1 779 524	0,21	271 800 CNY	China Construction Bank Corp	248 493	0,03
180 800 BRL	Vibra Energia SA	847 128	0,10	147 950 HKD	China Datang Corp Renewable Power Co Ltd	34 105	0,00
Brésil – Total				725 450 HKD	China International Marine Containers Group Co Ltd	464 523	0,05
Îles Caïmans				390 900 CNY	China International Marine Containers Group Co Ltd	419 963	0,05
3 884 000 HKD	Bosideng International Holdings Ltd	1 745 886	0,20	2 602 000 HKD	China Lesso Group Holdings Ltd	1 359 556	0,16
10 600 USD	Daqo New Energy Corp–ADR	281 960	0,03	1 128 000 HKD	China Medical System Holdings Ltd	1 999 285	0,23
509 000 HKD	Haitian International Holdings Ltd	1 259 374	0,15	774 656 HKD	China Merchants Bank Co Ltd	2 698 407	0,31
113 500 HKD	JNBY Design Ltd	152 621	0,02	139 700 CNY	China Merchants Bank Co Ltd	545 804	0,06
151 500 USD	Vipshop Holdings Ltd–ADR	2 690 640	0,31	592 000 HKD	China New Higher Education Group Ltd	161 485	0,02
308 000 HKD	Yihai International Holding Ltd	489 105	0,06	1 577 000 HKD	China Nonferrous Mining Corp Ltd	1 036 045	0,12
Îles Caïmans – Total				301 400 HKD	China Pacific Insurance Group Co Ltd	608 316	0,07
Chili				94 000 CNY	China Pacific Insurance Group Co Ltd	313 923	0,04
2 717 785 CLP	Aguas Andinas SA	885 715	0,10	730 000 HKD	China Railway Signal & Communication Corp Ltd	243 067	0,03
1 194 340 CLP	Cencosud SA	2 263 445	0,26	1 355 804 CNY	China Railway Signal & Communication Corp Ltd	833 978	0,10
4 885 193 CLP	Enel Chile SA	318 804	0,04				
889 589 CLP	SMU SA	164 821	0,02				
4 100 USD	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA–ADR	246 902	0,03				
21 547 CLP	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA–Preferred Stock	1 299 060	0,15				
Chili – Total							

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
123 300	CNY China Rare Earth Resources And Technology Co Ltd	479 133	0,06	433 500	HKD Hengan International Group Co Ltd	1 612 742	0,19
63 500	HKD China Resources Medical Holdings Co Ltd	39 197	0,00	187 400	CNY Hengdian Group DMEGC Magnetics Co Ltd	356 346	0,04
920 000	HKD China Resources Pharmaceutical Group Ltd	604 414	0,07	648 100	CNY HLA Group Corp Ltd	675 351	0,08
160 271	HKD China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	149 217	0,02	71	CNY Imeik Technology Development Co Ltd	2 935	0,00
851 100	CNY China State Construction Engineering Corp Ltd	574 922	0,07	3 995 503	HKD Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1 954 629	0,23
1 009 900	CNY China Suntien Green Energy Corp Ltd	1 153 061	0,13	28 500	HKD Innovent Biologics Inc	156 031	0,02
13 536 000	HKD China Tower Corp Ltd	1 421 457	0,17	311 988	CNY JA Solar Technology Co Ltd	907 844	0,11
964 400	HKD China Vanke Co Ltd	891 711	0,10	289 297	HKD JD.com Inc	4 167 984	0,48
583 600	CNY China West Construction Group Co Ltd	531 097	0,06	911 369	HKD Jiangsu Expressway Co Ltd	819 334	0,10
216 599	CNY China Yangtze Power Co Ltd	709 971	0,08	381 000	HKD Jiangxi Copper Co Ltd	538 671	0,06
192 900	CNY City Development Environment Co Ltd	307 205	0,04	16 900	USD JinkoSolar Holding Co Ltd	624 286	0,07
3 672 000	HKD CMOC Group Ltd	2 007 984	0,23	86 930	USD JOYY Inc-ADR	3 451 121	0,40
356 246	CNY CMOC Group Ltd	260 158	0,03	226 200	USD Kanzhun Ltd	3 757 182	0,44
64 440	CNY Contemporary Amperex Technology Co Ltd	1 477 470	0,17	516 000	HKD Kingdee International Software Group Co Ltd	752 006	0,09
1 549 550	HKD Cosco Shipping Holdings Co Ltd	1 557 775	0,18	74 600	HKD Kingsoft Corp Ltd	230 242	0,03
2 391 000	HKD CRRR Corp Ltd	1 053 338	0,12	731 400	HKD Kuaishou Technology	4 959 644	0,57
179 900	CNY CSG Holding Co Ltd	140 725	0,02	2 414 000	HKD Lenovo Group Ltd	3 375 899	0,39
296 300	CNY Daqin Railway Co Ltd	300 020	0,04	79 000	HKD Li Auto Inc	1 488 228	0,17
313 700	CNY Dongjiang Environmental Co Ltd	226 004	0,03	196 293	CNY Liaoning Port Co Ltd	39 972	0,00
158 500	HKD EEKA Fashion Holdings Ltd	287 829	0,03	499 000	CNY Lingyi iTech Guangdong Co	473 730	0,06
192 600	CNY Fanli Digital Technology Co Ltd	210 977	0,02	1 008 000	HKD Longfor Group Holdings Ltd	1 613 616	0,19
145 400	USD FinVolution Group-ADR	712 460	0,08	238 116	CNY LONGi Green Energy Technology Co Ltd	765 786	0,09
75 400	CNY Focus Technology Co Ltd	350 813	0,04	175 350	USD Lufax Holding Ltd	538 325	0,06
236 000	CNY Foxconn Industrial Internet Co Ltd	501 126	0,06	233 800	CNY Meihua Holdings Group Co Ltd	313 568	0,04
83 200	HKD Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	404 890	0,05	3 838 000	HKD Meituan	1 769 445	0,21
821 480	CNY Ganfeng Lithium Group Co Ltd	3 590 857	0,41	448 000	HKD Meituan	4 698 849	0,54
325 200	HKD GDS Holdings Ltd	377 319	0,04	53 200	HKD MINISO Group Holding Ltd	273 544	0,03
439 400	CNY GEM Co Ltd	336 927	0,04	338 550	HKD NetEase Inc	6 095 899	0,71
1 370 000	HKD Goldwind Science & Technology Co Ltd	615 825	0,07	76 600	HKD New Oriental Education & Technology Group Inc	541 989	0,06
738 600	CNY Goldwind Science & Technology Co Ltd	829 818	0,10	44 100	CNY Ningbo Shanshan Co Ltd	84 353	0,01
3 368	CNY GoodWe Technologies Co Ltd	61 764	0,01	109 100	USD NIO Inc-ADR	989 537	0,12
17 906	HKD Great Wall Motor Co Ltd	23 252	0,00	452 400	HKD Nongfu Spring Co Ltd	2 615 833	0,30
148 000	HKD Greentown Management Holdings Co Ltd	101 781	0,01	61 950	USD PDD Holdings Inc-ADR	9 063 904	1,05
383 100	CNY Guangdong Provincial Expressway Development Co Ltd	455 162	0,05	951 000	HKD People's Insurance Co Group of China Ltd	292 295	0,03
7 198 000	HKD Guangshen Railway Co Ltd	1 401 151	0,16	1 957 846	HKD PICC Property & Casualty Co Ltd	2 326 784	0,27
8 000	USD H World Group Ltd-ADR	267 520	0,03	1 134 500	HKD Ping An Insurance Group Co of China Ltd	5 135 982	0,60
253 000	HKD Haidilao International Holding Ltd	471 102	0,05	312 100	CNY Ping An Insurance Group Co of China Ltd	1 766 372	0,20
115 800	HKD Haier Smart Home Co Ltd	326 999	0,04	415 400	HKD Pop Mart International Group Ltd	1 077 261	0,13
121 000	HKD Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	187 500	0,02	36 300	USD Qifu Technology Inc	574 266	0,07
407 900	USD Hello Group Inc	2 834 905	0,33	77 400	USD Qudian Inc-ADR	157 896	0,02
				18 900	CNY Seres Group Co Ltd	202 255	0,02
				41 609	CNY Shanghai International Port Group Co Ltd	28 633	0,00
				437 800	HKD Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	640 282	0,07

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
384 700	CNY Shenghe Resources Holding Co Ltd	549 988	0,06	45 100	HKD Zhihu Inc	83 517	0,01
46 080	CNY Shenzhen Capchem Technology Co Ltd	306 096	0,04	232 400	HKD ZJLD Group Inc	292 265	0,03
97 400	CNY Shenzhen Expressway Corp Ltd	122 971	0,01	Chine – Total			
13 230	CNY Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	539 932	0,06	200 756 439			
175 100	CNY Sichuan Changhong Electric Co Ltd	130 084	0,02	23,26			
65 250	CNY Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd	266 201	0,03	Colombie			
126 200	CNY Sinoma Science & Technology Co Ltd	282 154	0,03	14 113	COP Bancolombia SA	120 948	0,02
942 000	HKD Sinotrans Ltd	394 483	0,05	37 188	COP Bancolombia SA–Preferred Stock	287 213	0,03
896 200	CNY Sinotrans Ltd	659 507	0,08	Colombie – Total			
155 400	CNY Sungrow Power Supply Co Ltd	1 911 564	0,22	408 161			
1 452 956	CNY TangShan Port Group Co Ltd	714 174	0,08	Chypre			
193 960	CNY TBEA Co Ltd	375 902	0,04	8 879	USD TCS Group Holding PLC–GDR*	0	0,00
225 625	CNY TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd	495 573	0,06	Chypre – Total			
579 702	CNY Tianjin Capital Environmental Protection Group Co Ltd	451 836	0,05	0			
536 000	HKD Tianneng Power International Ltd	452 355	0,05	République tchèque			
20 100	CNY Tianqi Lithium Corp	157 484	0,02	16 990	CZK Komerční Banka AS	550 760	0,07
1 380 000	HKD Times China Holdings Ltd	45 950	0,01	374 870	CZK Moneta Money Bank AS	1 569 953	0,18
100 800	HKD Tongcheng Travel Holdings Ltd	186 405	0,02	République tchèque – Total			
1 089 400	HKD Tongdao Liepin Group	804 994	0,09	2 120 713			
31 700	CNY Tongwei Co Ltd	111 430	0,01	Grèce			
435 000	HKD Topsports International Holdings Ltd	338 706	0,04	475 236	EUR Eurobank Ergasias Services and Holdings SA	845 201	0,10
118 400	USD Trip.com Group Ltd–ADR	4 263 584	0,49	58 218	EUR Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	1 528 018	0,18
1 562 000	HKD Uni-President China Holdings Ltd	1 110 206	0,13	60 925	EUR Mytilineos SA	2 469 940	0,28
1 034 300	CNY Visual China Group Co Ltd	2 135 243	0,25	Grèce – Total			
2 691 000	HKD Want Want China Holdings Ltd	1 626 617	0,19	4 843 159			
332 500	CNY Western Mining Co Ltd	666 345	0,08	Hong Kong			
200 500	HKD WuXi AppTec Co Ltd	2 040 036	0,24	2 094 000	HKD Alibaba Health Information Technology Ltd	1 137 031	0,13
26 200	CNY WuXi AppTec Co Ltd	267 718	0,03	887 000	HKD China Everbright Environment Group Ltd	288 527	0,03
472 000	HKD Wuxi Biologics Cayman Inc	1 789 218	0,21	788 000	HKD China High Speed Transmission Equipment Group Co Ltd	164 491	0,02
131 933	CNY Xiamen Tungsten Co Ltd	318 317	0,04	1 179 340	HKD China Overseas Land & Investment Ltd	2 078 199	0,24
2 447 000	HKD Xiaomi Corp	4 888 641	0,57	446 000	HKD China Resources Land Ltd	1 599 273	0,19
2 238 000	HKD Xinyi Solar Holdings Ltd	1 306 937	0,15	226 000	HKD China State Construction International Holdings Ltd	261 352	0,03
1 272 000	HKD Yadea Group Holdings Ltd	2 234 966	0,26	4 530 000	HKD Concord New Energy Group Ltd	371 285	0,04
245 900	CNY Yuan Longping High-tech Agriculture Co Ltd	486 924	0,06	12 297 000	HKD GCL Technology Holdings Ltd	1 952 767	0,23
82 400	CNY Yunnan Copper Co Ltd	126 020	0,01	2 622 000	HKD Kunlun Energy Co Ltd	2 363 932	0,28
3 500	CNY Yunnan Energy New Material Co Ltd	27 929	0,00	18 500	HKD Orient Overseas International Ltd	258 243	0,03
1 066 300	CNY Yutong Bus Co Ltd	1 984 169	0,23	775 100	HKD Sinofer Holdings Ltd	90 329	0,01
54 800	HKD Zai Lab Ltd	150 886	0,02	440 000	HKD Sinotruk Hong Kong Ltd	863 259	0,10
885 000	CNY Zhefu Holding Group Co Ltd	422 577	0,05	1 402 267	HKD Skyworth Group Ltd	535 151	0,06
23 976	CNY Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	72 427	0,01	217 100	HKD Yuexiu Property Co Ltd	176 826	0,02
1 960 700	USD Zhihu Inc	1 835 999	0,21	Hong-Kong – Total			
				12 140 665			
				Hongrie			
				430 554	HUF Magyar Telekom Telecommunications PLC	848 651	0,10
				185 519	HUF MOL Hungarian Oil & Gas PLC	1 515 226	0,17
				Hongrie – Total			
				2 363 877			
				Inde			
				40 911	INR ABB India Ltd	2 298 332	0,27
				70 566	INR Adani Green Energy Ltd	1 354 270	0,16
				40 000	INR Allcargo Terminals Ltd	25 260	0,00
				31 039	INR Apollo Hospitals Enterprise Ltd	2 127 648	0,25

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)				
Inde (suite)				Inde (suite)				
62 850	INR Arvind Ltd	197 469	0,02	194 764	INR NMDC Ltd	490 691	0,06	
41 358	INR Asian Paints Ltd	1 691 024	0,20	304 981	INR Oil India Ltd	1 363 941	0,16	
12 894	INR Aurobindo Pharma Ltd	167 966	0,02	786 653	INR Petronet LNG Ltd	2 104 800	0,24	
45 024	INR Avanti Feeds Ltd	227 274	0,03	3 395	INR PI Industries Ltd	143 444	0,02	
250 199	INR Axis Bank Ltd	3 314 288	0,38	566 721	INR Power Finance Corp Ltd	2 605 669	0,30	
21 700	USD Azure Power Global Ltd	27 125	0,00	1 246 396	INR Power Grid Corp of India Ltd	3 552 840	0,41	
17 110	INR Bajaj Finance Ltd	1 506 696	0,17	526 799	INR REC Ltd	2 613 618	0,30	
207 160	INR Bank of Baroda	575 322	0,07	200 102	INR Reliance Industries Ltd	6 215 964	0,72	
458 871	INR Bharat Petroleum Corp Ltd	2 485 049	0,29	46 161	USD Reliance Industries Ltd–GDR	2 885 063	0,33	
248 017	INR Bharti Airtel Ltd	3 076 452	0,36	475 057	INR State Bank of India	3 665 384	0,42	
5 707	INR Bombay Burmah Trading Co	107 969	0,01	227 562	INR Sun Pharmaceutical Industries Ltd	3 444 178	0,40	
19 913	INR Britannia Industries Ltd	1 277 488	0,15	25 749	INR Sun TV Network Ltd	220 378	0,03	
215 510	INR Castrol India Ltd	465 523	0,05	29 356	INR Supreme Industries Ltd	1 602 654	0,19	
114 928	INR Chennai Petroleum Corp Ltd	961 258	0,11	8 250	INR Supreme Petrochem Ltd	55 480	0,01	
19 779	INR Cipla Ltd	296 232	0,03	3 638 096	INR Suzlon Energy Ltd	1 670 100	0,19	
60 913	INR Colgate-Palmolive India Ltd	1 851 757	0,21	32 813	INR Tata Communications Ltd	698 068	0,08	
42 338	INR Dr Reddy's Laboratories Ltd	2 949 891	0,34	180 045	INR Tata Consumer Products Ltd	2 351 449	0,27	
105 678	INR Embassy Office Parks REIT	412 292	0,05	318 887	INR Tata Motors Ltd	2 988 880	0,35	
101 545	INR Glenmark Pharmaceuticals Ltd	1 042 068	0,12	75 084	INR Tata Motors Ltd	468 566	0,05	
124 335	INR Godrej Consumer Products Ltd	1 690 198	0,20	189 553	INR Tech Mahindra Ltd	2 898 976	0,34	
7 639	INR Grasim Industries Ltd	195 974	0,02	51 265	INR Titan Co Ltd	2 264 313	0,26	
249 876	INR Gujarat State Petronet Ltd	918 863	0,11	40 000	INR TransIndia Real Estate Ltd	21 823	0,00	
232 514	INR HCL Technologies Ltd	4 096 544	0,47	162 727	INR UPL Ltd	1 148 385	0,13	
4 464	INR HDFC Asset Management Co Ltd	171 932	0,02	103 739	INR Varun Beverages Ltd	1 541 990	0,18	
229 437	INR HDFC Bank Ltd	4 712 745	0,55	42 352	INR Welspun India Ltd	73 518	0,01	
52 385	INR Hero MotoCorp Ltd	2 605 943	0,30	523 232	INR Wipro Ltd	2 963 443	0,34	
1 660	INR HIL Ltd	56 127	0,01	Inde – Total			140 175 903	16,24
455 194	INR Hindalco Industries Ltd	3 363 339	0,39	Indonésie				
84 272	INR Hindustan Aeronautics Ltd	2 839 659	0,33	6 046 600	IDR Astra International Tbk PT	2 218 828	0,26	
258 171	INR Hindustan Petroleum Corp Ltd	1 237 589	0,14	5 767 300	IDR Bank Central Asia Tbk PT	3 520 986	0,41	
141 210	INR Hindustan Unilever Ltd	4 520 604	0,52	9 822 700	IDR Bank Mandiri Persero Tbk PT	3 859 670	0,45	
494 501	INR ICICI Bank Ltd	5 922 335	0,69	1 480 500	IDR Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	516 833	0,06	
27 381	INR ICICI Securities Ltd	236 254	0,03	14 046 995	IDF Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	5 223 033	0,60	
870 479	INR IDFC First Bank Ltd	929 962	0,11	3 146 300	IDR Barito Pacific Tbk PT	271 779	0,03	
335 945	INR Indian Hotels Co Ltd	1 769 677	0,21	4 921 600	IDR Indofood Sukses Makmur Tbk PT	2 061 721	0,24	
1 714 207	INR Indian Oil Corp Ltd	2 674 916	0,31	Indonésie – Total			17 672 850	2,05
252 466	INR Indraprastha Gas Ltd	1 269 251	0,15	Corée				
55 588	INR IndusInd Bank Ltd	1 068 122	0,12	34 414	KRW AfreecaTV Co Ltd	2 287 319	0,26	
42 655	INR Info Edge India Ltd	2 634 818	0,31	17	KRW Celltrion Inc	2 660	0,00	
51 442	INR Infosys Ltd	953 807	0,11	26	KRW Chong Kun Dang Pharmaceutical Corp	2 643	0,00	
453 558	USD Infosys Ltd–ADR	8 336 396	0,97	26 086	KRW Connectwave Co Ltd	310 302	0,04	
1 026	INR JK Lakshmi Cement Ltd	11 089	0,00	44 741	KRW Coway Co Ltd	1 987 099	0,23	
103 199	INR Just Dial Ltd	994 862	0,12	24 844	KRW Daishin Securities Co Ltd	275 851	0,03	
48 251	INR Kaveri Seed Co Ltd	355 212	0,04	34 642	KRW DB Insurance Co Ltd	2 251 367	0,26	
53 510	INR Kotak Mahindra Bank Ltd	1 226 990	0,14	1 454	KRW Ecopro Co Ltd	730 443	0,08	
94 851	INR Lupin Ltd	1 507 962	0,17	3 550	KRW Eugene Corp	9 496	0,00	
158 503	INR Mahindra & Mahindra Ltd	3 294 108	0,38	27 433	KRW GemVax & Kael Co Ltd	282 871	0,03	
132 527	INR Manappuram Finance Ltd	273 929	0,03	20	KRW GOLFZON Co Ltd	1 432	0,00	
734	INR Maruti Suzuki India Ltd	90 874	0,01	81 954	KRW Hana Financial Group Inc	2 761 708	0,32	
16 852	INR Narayana Hrudayalaya Ltd	243 412	0,03					
133 615	INR NCC Ltd	267 748	0,03					
1 561 731	INR NHPC Ltd	1 212 394	0,14					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets			
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)						
Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)						
Corée (suite)				Malaisie						
62 604	KRW Hankook Tire & Technology Co Ltd	2 206 865	0,26	380 300	MYR AMMB Holdings Bhd	331 883	0,04			
52 375	KRW Hanwha Solutions Corp	1 606 346	0,19	692 900	MYR Bermaz Auto Bhd	355 875	0,04			
7 892	KRW Hyundai Glovis Co Ltd	1 173 475	0,14	3 229 100	MYR Bumi Armada Bhd	347 857	0,04			
822	KRW Hyundai Home Shopping Network Corp	27 477	0,00	1 252 200	MYR CIMB Group Holdings Bhd	1 594 205	0,18			
17 987	KRW Hyundai Mobis Co Ltd	3 309 977	0,38	30 400	MYR Fraser & Neave Holdings Bhd	186 303	0,02			
29 453	KRW Hyundai Motor Co	4 653 844	0,54	220 685	MYR Gamuda Bhd	220 445	0,03			
15 590	KRW Hyundai Steel Co	441 832	0,05	277 800	MYR IHH Healthcare Bhd	364 556	0,04			
88 071	KRW Kakao Corp	3 713 219	0,43	301 900	MYR IJM Corp Bhd	123 520	0,01			
90 288	KRW KB Financial Group Inc	3 792 671	0,44	1 007 000	MYR IOI Corp Bhd	861 264	0,10			
16 558	KRW KEPCO Engineering & Construction Co Inc	798 394	0,09	1 104 000	MYR KPJ Healthcare Bhd	345 976	0,04			
66 910	KRW KG Chemical Corp	355 877	0,04	132 200	MYR Kuala Lumpur Kepong Bhd	627 770	0,07			
60 741	KRW Kia Corp	4 716 282	0,55	348 923	MYR Malayan Banking Bhd	675 065	0,08			
8 073	KRW Korean Air Lines Co Ltd	149 813	0,02	433 670	MYR Petronas Chemicals Group Bhd	675 751	0,08			
8 991	KRW Korean Reinsurance Co	49 915	0,01	151 100	MYR Public Bank Bhd	141 071	0,02			
1 520	KRW Kumho Petrochemical Co Ltd	156 851	0,02	1 668 713	MYR RHB Bank Bhd	1 979 213	0,23			
5 504	KRW LG Chem Ltd	2 132 538	0,25	375 200	MYR Sime Darby Plantation Bhd	364 177	0,04			
13 443	KRW LG Electronics Inc	1 062 580	0,12	50 236	MYR TSH Resources Bhd	10 659	0,00			
320 319	KRW Mirae Asset Securities Co Ltd	1 897 689	0,22	61 100	MYR United Plantations BHD	236 688	0,03			
27 817	KRW Naver Corp	4 838 115	0,56	Malaisie – Total			9 442 278	1,09		
60 507	KRW NH Investment & Securities Co Ltd	485 315	0,06	Mexique						
785	KRW POSCO FUTURE M Co Ltd	218 817	0,02	189 000	MXN Alsea SAB de CV	716 067	0,08			
10 796	KRW Samsung C&T Corp	1 085 552	0,13	250 999	MXN Arca Continental SAB de CV	2 748 101	0,32			
13 255	KRW Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	1 576 726	0,18	162 100	MXN Banco del Bajío SA	543 700	0,06			
612 923	KRW Samsung Electronics Co Ltd	37 358 844	4,33	445 500	USD Cemex SAB de CV–ADR	3 452 625	0,40			
71 447	KRW Samsung Electronics Co Ltd–Preferred Stock	3 456 129	0,40	132 595	MXN Coca-Cola Femsa SAB de CV	1 260 375	0,15			
10 361	KRW Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	2 115 803	0,24	1 270 600	MXN Fibra Uno Administracion SA de CV REIT	2 293 675	0,26			
6 892	KRW Samsung SDI Co Ltd	2 525 836	0,29	130 600	MXN Fomento Economico Mexicano SAB de CV	1 704 367	0,20			
9 287	KRW Samsung SDS Co Ltd	1 225 864	0,14	8 020	MXN Gruma SAB de CV	147 353	0,02			
67 084	KRW Samsung Securities Co Ltd	2 005 384	0,23	117 900	MXN Grupo Bimbo SAB de CV	598 394	0,07			
122 953	KRW Shinhan Financial Group Co Ltd	3 833 033	0,44	478 455	MXN Grupo Financiero Banorte SAB de CV	4 824 528	0,56			
43 739	KRW SK Hynix Inc	4 805 550	0,56	454 692	MXN Grupo Mexico SAB de CV	2 528 737	0,29			
10 499	KRW SK Telecom Co Ltd	408 417	0,05	621 800	MXN Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	1 401 524	0,16			
71 962	KRW Tongyang Inc	55 820	0,01	605 800	MXN Orbia Advance Corp SAB de CV	1 345 785	0,16			
57 639	KRW Woori Financial Group Inc	581 805	0,07	146 500	MXN Wal-Mart de Mexico SAB de CV	619 150	0,07			
Corée – Total				Mexique – Total			24 184 381	2,80		
109 725 846				12,71						
Koweït				Philippines						
153 910	KWD Kuwait Finance House KSCP	363 673	0,04	500 370	PHP Bank of the Philippine Islands	937 940	0,11			
23 474	KWD Mabaneer Co KPSC	64 406	0,01	13 560	PHP GT Capital Holdings Inc	144 477	0,02			
63 046	KWD Mezzan Holding Co KSCC	117 987	0,01	495 890	PHP International Container Terminal Services Inc	2 210 125	0,25			
1 189 491	KWI Mobile Telecommunications Co KSCP	1 962 805	0,23	33 880	PHP PLDT Inc	782 528	0,09			
833 786	KWD National Bank of Kuwait SAKP	2 426 053	0,28	Philippines – Total			4 075 070	0,47		
43 381	KWD National Industries Group Holding SAK	28 803	0,00	Pologne						
Koweït – Total				4 963 727			0,57			
				3 355				PLN Bank Handlowy w Warszawie SA	86 515	0,01
				49 196				PLN Bank Polska Kasa Opieki SA	1 902 283	0,22
				1 157				PLN Budimex SA	184 190	0,02
				263 772				PLN Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	3 375 423	0,39

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)			
Pologne (suite)				Singapour			
69 478	PLN Powszechny Zakład Ubezpieczeń SA	835 202	0,10	49 000	HKD BOC Aviation Ltd	374 628	0,04
8 512	PLN Wirtualna Polska Holding SA	263 223	0,03	Singapour – Total			
Pologne – Total				374 628 0,04			
6 646 836 0,77				Afrique du Sud			
Qatar				60 721 ZAR Anglo American Platinum Ltd			
245 735	QAR Commercial Bank PSQC	401 572	0,05	286 114	ZAR FirstRand Ltd	1 150 088	0,13
817 779	QAR Ooredoo QPSC	2 448 171	0,29	217 049	ZAR Gold Fields Ltd	3 296 890	0,38
173 828	QAR Qatar Fuel QSC	780 579	0,09	53 817	ZAR Harmony Gold Mining Co Ltd	351 933	0,04
471 171	QAR Qatar Islamic Bank SAQ	2 704 607	0,31	513 931	ZAR Impala Platinum Holdings Ltd	2 564 948	0,30
410 007	QAR Qatar National Bank QPSC	1 807 364	0,21	73 938	ZAR Kumba Iron Ore Ltd	2 485 611	0,29
382 049	QAR Vodafone Qatar QSC	197 268	0,02	3 309	ZAR Life Healthcare Group Holdings Ltd	3 324	0,00
Qatar – Total				24 521 ZAR Naspers Ltd 4 194 214 0,49			
8 339 561 0,97				608 313 ZAR Old Mutual Ltd 434 426 0,05			
Russie				11 797 ZAR Reunert Ltd 38 666 0,00			
2 393 118	RUB Gazprom PJSC*	0	0,00	234 807	ZAR Sanlam Ltd	934 734	0,11
74 109	USD Globaltrans Investment PLC–GDR*	0	0,00	152 869	ZAR Shoprite Holdings Ltd	2 299 200	0,27
45 639	RUB LUKOIL PJSC*	0	0,00	1 281 283	ZAR Sibanye Stillwater Ltd	1 744 577	0,20
3 679	USD Novatek PJSC–GDR*	0	0,00	355 753	ZAR Standard Bank Group Ltd	4 048 240	0,47
123 890	USD Novolipetsk Steel PJSC–GDR*	0	0,00	75 932	ZAR Woolworths Holdings Ltd	299 783	0,03
166 849	USD Severstal PAO–GDR*	0	0,00	94 699	ZAR Zeda Ltd	66 024	0,01
62 908	USD X5 Retail Group NV–GDR*	0	0,00	Afrique du Sud – Total			
Russie – Total				27 113 481 3,14			
0 0,00				Taiwan			
Arabie saoudite				61 000 TWD Accton Technology Corp 1 039 507 0,12			
184 233	SAR Abdullah Al Othaim Markets Co	643 587	0,07	87 520	TWD Acter Group Corp Ltd	506 176	0,06
52 415	SAR Al Hammadi Holding	834 447	0,10	88 000	TWD Addcn Technology Co Ltd	570 600	0,07
238 572	SAR Al Rajhi Bank	5 534 870	0,64	842 000	TWD ASE Technology Holding Co Ltd	3 703 752	0,43
12 091	SAR Al-Dawaa Medical Services Co	340 483	0,04	136 000	TWD Asustek Computer Inc	2 169 140	0,25
124 767	SAR Alinma Bank	1 289 259	0,15	875 035	TWD Cathay Financial Holding Co Ltd	1 304 405	0,15
72 994	SAR Almarai Co JSC	1 093 937	0,13	8 080	TWD Chailease Holding Co Ltd	50 812	0,01
210 171	SAR Arab National Bank	1 420 756	0,16	269 000	TWD Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	393 545	0,05
20 636	SAR Astra Industrial Group	727 488	0,08	90 000	TWD Chicony Power Technology Co Ltd	426 679	0,05
208 565	SAR Banque Saudi Fransi	2 224 693	0,26	349 000	TWD China Development Financial Holding Corp	142 714	0,02
8 099	SAR Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co	460 455	0,05	71 000	TWD China Motor Corp	261 416	0,03
201 287	SAR Etihad Etisalat Co	2 651 621	0,31	114 000	TWD Chunghwa Telecom Co Ltd	445 741	0,05
44 199	SAR Middle East Healthcare Co	1 044 275	0,12	70 000	TWD Cleanaway Co Ltd	410 551	0,05
278 820	SAR Mobile Telecommunications Co Saudi Arabia	1 049 850	0,12	164 000	TWD Compal Electronics Inc	212 945	0,02
24 592	SAR National Medical Care Co	1 143 692	0,13	4 313 210	TWD CTBC Financial Holding Co Ltd	3 984 279	0,46
51 607	SAR Riyadh Bank	392 901	0,05	337 000	TWD Delta Electronics Inc	3 442 417	0,40
82 311	SAR SABIC Agri-Nutrients Co	3 033 435	0,35	46 000	TWD Depo Auto Parts Ind Co Ltd	220 329	0,03
54 390	SAR Sahara International Petrochemical Co	493 861	0,06	455 000	TWD E Ink Holdings Inc	2 920 611	0,34
13 992	SAR Saudi Automotive Services Co	277 228	0,03	2 320 000	TWD Eva Airways Corp	2 377 413	0,28
15 247	SAR Saudi Awwal Bank	152 877	0,02	493 000	TWD Everlight Electronics Co Ltd	803 180	0,09
120 100	SAR Saudi Chemical Co Holding	137 074	0,02	767 000	TWD Far Eastern Department Stores Ltd	618 538	0,07
157 177	SAR Saudi National Bank	1 622 067	0,19	1 139 000	TWD Far Eastern New Century Corp	1 157 909	0,13
397 703	SAR Saudi Telecom Co	4 289 890	0,50	2 731 189	TWD First Financial Holding Co Ltd	2 438 363	0,28
2 003	SAR Saudia Dairy & Foodstuff Co	177 866	0,02	1 940 969	TWD Fubon Financial Holding Co Ltd	4 098 167	0,47
86 724	SAR Savola Group	863 771	0,10	209 000	TWD Goldsun Building Materials Co Ltd	191 699	0,02
45 135	SAR United International Transportation Co	947 233	0,11	1 882 151	TWD Hon Hai Precision Industry Co Ltd	6 408 654	0,74
Arabie saoudite – Total				44 009 TWD Kindom Development Co Ltd 55 709 0,01			
32 847 616 3,81				3 000 TWD Largan Precision Co Ltd 280 543 0,03			

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 96,97 % (suite)					
Taïwan (suite)				Émirats arabes unis					
464 590	TWD Lite-On Technology Corp	1 771 135	0,20	916 550	AED Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	2 290 907	0,26		
245 000	TWD MediaTek Inc	8 102 670	0,94	403 036	AED Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	1 110 537	0,13		
968 753	TWD Mega Financial Holding Co Ltd	1 237 357	0,14	950 770	AED Abu Dhabi National Oil Co for Distribution PJSC	957 824	0,11		
50 000	TWD Merry Electronics Co Ltd	178 394	0,02	1 408 539	AED Aldar Properties PJSC	2 051 782	0,24		
217 999	TWD Microbio Co Ltd	358 709	0,04	223 477	AED Emaar Development PJSC	435 058	0,05		
35 000	TWD MPI Corp	248 041	0,03	652 754	AED Emirates NBD Bank PJSC	3 074 711	0,36		
72 000	TWD Novatek Microelectronics Corp	1 212 884	0,14	28 549	AED Emirates Telecommunications Group Co PJSC	152 666	0,02		
871 591	TWD Pou Chen Corp	877 541	0,10	240 439	AED First Abu Dhabi Bank PJSC	913 901	0,10		
105 000	TWD Primax Electronics Ltd	231 619	0,03	131 829	AED Ras Al Khaimah Ceramics	95 836	0,01		
366 000	TWD Quanta Computer Inc	2 677 278	0,31	26 300	USD Yalla Group Ltd-ADR	161 219	0,02		
114 000	TWD Sercomm Corp	499 601	0,06	Émirats arabes unis – Total			11 244 441	1,30	
18 000	TWD Simplo Technology Co Ltd	246 330	0,03	Royaume-Uni					
4 398 880	TWD SinoPac Financial Holdings Co Ltd	2 823 608	0,33	59 300	USD VTEX	407 984	0,05		
1 694 161	TWD Taishin Financial Holding Co Ltd	999 147	0,12	Royaume-Uni – Total			407 984	0,05	
2 217 000	TWD Taiwan High Speed Rail Corp	2 217 686	0,26	États-Unis					
3 013 403	TWD Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	58 224 792	6,75	149 000	HKD BeiGene Ltd	2 100 889	0,24		
185 208	TWD Taiwan Shin Kong Security Co Ltd	243 500	0,03	5 900	USD Southern Copper Corp	507 813	0,06		
120 000	TWD Teco Electric and Machinery Co Ltd	182 988	0,02	52 095	USD Yum China Holdings Inc	2 210 391	0,26		
923 000	TWD Uni-President Enterprises Corp	2 240 547	0,26	États-Unis – Total			4 819 093	0,56	
1 433 000	TWD United Microelectronics Corp	2 455 998	0,28	Total des actions ordinaires et préférentielles				837 027 152	96,97
336 000	TWD Wistron Corp	1 079 474	0,12	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				837 027 152	96,97
3 599 012	TWD Yuanta Financial Holding Co Ltd	3 236 595	0,37	Autres valeurs mobilières					
Taïwan – Total				Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 %					
131 981 688		15,29		Îles Caïmans					
Thaïlande				193 800	HKD China Metal Recycling Holdings Ltd*	0	0,00		
322 800	THB Advanced Info Service PCL	2 052 226	0,24	Îles Caïmans – Total			0	0,00	
1 892 600	THB Amata Corp PCL	1 483 251	0,17	Hong Kong					
176 200	THB Bangkok Bank PCL	807 890	0,09	480 000	HKD China Common Rich Renewable Energy Investments Ltd*	0	0,00		
731 200	THB Bangkok Dusit Medical Services PCL	594 471	0,07	Hong-Kong – Total			0	0,00	
753 400	THB Indorama Ventures PCL	601 484	0,07	Russie					
43 000	THB Kasikornbank PCL	166 923	0,02	2 120 313	RUB Alrosa PJSC*	0	0,00		
538 700	THB PTT Exploration & Production PCL	2 359 500	0,27	2 961 441	RUB Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC*	0	0,00		
125 400	THB Siam Cement PCL	1 124 219	0,13	385 950	RUB Mobile TeleSystems PJSC*	0	0,00		
256 300	THB SPCG PCL	93 111	0,01	130 366	USD PhosAgro PJSC-GDR*	0	0,00		
914 300	THB Thai Oil PCL	1 439 790	0,17	840	USD PHOSAGRO PJSC*	0	0,00		
713 700	THB Tisco Financial Group PCL	2 085 742	0,24	572 356	RUB Rosneft Oil Co PJSC*	0	0,00		
14 674 700	THB WHA Corp PCL	2 278 647	0,27	2 784 346	RUB Sberbank of Russia PJSC*	0	0,00		
Thaïlande – Total				133 942	RUB Tatneft PJSC*	0	0,00		
15 087 254		1,75		835 074 272	RUB VTB Bank PJSC*	0	0,00		
Turquie				10 529	RUB Yandex NV*	0	0,00		
83 488	TRY Arcelik AS	363 250	0,04	Russie – Total			0	0,00	
22 063	TRY Ford Otomotiv Sanayi AS	552 434	0,06						
431 434	TRY KOC Holding AS	2 071 421	0,24						
88 637	TRY Migros Ticaret AS	1 005 397	0,12						
615 888	TRY Turkiye Is Bankasi AS	487 138	0,06						
393 148	TRY Turkiye Petrol Rafinerileri AS	1 903 574	0,22						
579 540	TRY Yapi ve Kredi Bankasi AS	383 430	0,04						
Turquie – Total									
6 766 644		0,78							

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Autres valeurs mobilières (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 % (suite)			
Taïwan			
140	TWD Mega Financial Holding Co Ltd	28	0,00
Taïwan – Total		28	0,00
Total des actions ordinaires et préférentielles		28	0,00
Total des autres valeurs mobilières		28	0,00
TOTAL DES INVESTISSEMENTS		837 027 180	96,97

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,05 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	434	22 431 290	440 105	0,05
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés				440 105	0,05
Total des contrats à terme standardisés				440 105	0,05
Autres actifs/(passifs) nets				25 716 512	2,98
TOTAL DES ACTIFS NETS				863 183 797	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 220 350 USD détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

* Le Conseil d'administration a décidé de fixer le prix du titre à 0,00 conformément aux procédures d'évaluation des investissements en vigueur.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 %				Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (<i>suite</i>)			
Brésil				Chili (<i>suite</i>)			
577 946	USD Ambev SA–ADR	1 618 249	0,29	11 700	USD Sociedad Quimica y Minera de Chile SA–ADR	704 574	0,12
34 170	BRL Auren Energia SA	93 627	0,02	2 533	CLP Sociedad Quimica y Minera de Chile SA–Preferred Stock	152 714	0,03
507 400	BRL B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1 519 818	0,27				
126	BRL Banco Bradesco SA	396	0,00				
235 657	USD Banco Bradesco SA–ADR	824 800	0,15	Chili – Total		3 448 327	0,61
207 503	BRL Banco Bradesco SA–Preferred Stock	730 037	0,13				
159 600	BRL Banco do Brasil SA	1 819 879	0,32	Chine			
138 400	BRL BB Seguridade Participacoes SA	958 737	0,17	1 174 500	HKD 3SBio Inc	1 131 099	0,20
24 300	BRL Cia de Ferro Ligas da Bahia FERBASA–Preferred Stock	232 565	0,04	89 500	HKD AAC Technologies Holdings Inc	265 914	0,05
26 100	BRL Cia De Sanena Do Parana	156 839	0,03	367 600	CNY Agricultural Bank of China Ltd	187 915	0,03
508 339	BRL Cia Energetica de Minas Gerais–Preferred Stock	1 201 361	0,21	50 000	HKD Akeso Inc	297 110	0,05
156 500	BRL CPFL Energia SA	1 240 698	0,22	1 284 400	HKD Alibaba Group Holding Ltd	12 435 169	2,20
359 600	BRL CSN Mineracao SA	579 642	0,10	2 018 000	HKD Aluminum Corp of China Ltd	1 007 895	0,18
82 400	BRL Energisa S/A	913 124	0,16	229 800	CNY Aluminum Corp of China Ltd	182 017	0,03
285 050	BRL Gerdau SA–Preferred Stock	1 394 266	0,25	101 500	HKD Anhui Conch Cement Co Ltd	234 494	0,04
536 052	USD Itau Unibanco Holding SA–ADR	3 725 561	0,66	38 700	CNY Anhui Conch Cement Co Ltd	122 612	0,02
830 787	BRL Itausa SA–Preferred Stock	1 773 564	0,31	41 440	CNY Anhui Guangxin Agrochemical Co Ltd	84 386	0,02
116 000	BRL JBS SA	594 853	0,11	27 100	CNY Anhui Yingjia Distillery Co Ltd	252 290	0,04
158 600	BRL Kepler Weber SA	356 863	0,06	93 037	HKD ANTA Sports Products Ltd	902 543	0,16
192 800	BRL Klabin SA	881 920	0,16	62 200	USD Autohome Inc–ADR	1 745 332	0,31
275 984	BRL Petroleo Brasileiro SA	2 214 644	0,39	919 471	HKD BAIC Motor Corp Ltd	268 474	0,05
67 400	USD Petroleo Brasileiro SA–ADR	1 076 378	0,19	84 000	HKD Bairong Inc	145 441	0,03
369 700	BRL Petroleo Brasileiro SA–Preferred Stock	2 834 245	0,50	3 661 809	HKD Bank of China Ltd	1 397 467	0,25
18 500	BRL Raia Drogasil SA	111 969	0,02	1 304 000	HKD Bank of Communications Co Ltd	813 273	0,14
116 380	BRL SLC Agricola SA	450 896	0,08	242 220	CNY Baoshan Iron & Steel Co Ltd	201 720	0,04
116 200	BRL Suzano SA	1 330 741	0,24	948 000	HKD Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd	210 031	0,04
128 200	BRL Telefonica Brasil SA	1 410 369	0,25	157 100	CNY Beijing Zhidemai Technology Co Ltd	482 292	0,09
171 100	BRL TIM SA	631 551	0,11	16 660	HKD Bilibili Inc	199 701	0,04
26 100	BRL Unipar Carbocloro SA–Preferred Stock	411 520	0,07	119 500	HKD BYD Co Ltd	3 281 121	0,58
21 400	BRL Vibra Energia SA	100 269	0,02	15 230	CNY BYD Co Ltd	423 495	0,08
Brésil – Total		31 189 381	5,53	312 500	HKD BYD Electronic International Co Ltd	1 464 741	0,26
				5 205 000	HKD CGN Power Co Ltd	1 359 817	0,24
Îles Caïmans				857 000	CNY CGN Power Co Ltd	374 304	0,07
1 910 000	HKD Bosideng International Holdings Ltd	858 559	0,15	644 000	HKD China Communications Services Corp Ltd	267 215	0,05
103 500	HKD China Hongqiao Group Ltd	84 698	0,01	6 768 122	HKD China Construction Bank Corp	4 030 424	0,71
18 000	TWD Chilitina Holding Ltd	114 661	0,02	261 500	CNY China Construction Bank Corp	239 076	0,04
263 000	HKD Haitian International Holdings Ltd	650 717	0,12	1 715 000	HKD China Datang Corp Renewable Power Co Ltd	395 336	0,07
119 000	HKD JNBY Design Ltd	160 017	0,03	388 000	HKD China Feihe Ltd	212 173	0,04
17 800	USD TAL Education Group–ADR	224 814	0,04	319 000	HKD China Galaxy Securities Co Ltd	168 721	0,03
95 300	USD Vipshop Holdings Ltd–ADR	1 692 528	0,30	181 200	HKD China International Marine Containers Group Co Ltd	116 027	0,02
358 000	HKD Yihai International Holding Ltd	568 505	0,10	67 900	CNY China Jushi Co Ltd	93 736	0,02
Îles Caïmans – Total		4 354 499	0,77	625 000	HKD China Medical System Holdings Ltd	1 107 760	0,20
Chili				517 977	HKD China Merchants Bank Co Ltd	1 804 301	0,32
646 021	CLP Cencosud SA	1 224 302	0,22	180 569	CNY China Merchants Bank Co Ltd	705 478	0,13
3 272 074	CLP Colbun SA	523 811	0,09	19 600	CNY China National Medicines Corp Ltd	78 779	0,01
101 602	CLP Empresas CMPC SA	197 786	0,04				
4 584 379	CLP Enel Chile SA	299 173	0,05				
1 867 292	CLP SMU SA	345 967	0,06				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
487 000 HKD	China New Higher Education Group Ltd	132 843	0,02	280 000 HKD	Harbin Electric Co Ltd	74 226	0,01
265 000 HKD	China Nonferrous Mining Corp Ltd	174 098	0,03	69 900 USD	Hello Group Inc	485 805	0,09
335 600 HKD	China Pacific Insurance Group Co Ltd	677 342	0,12	25 900 CNY	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd	97 153	0,02
125 800 CNY	China Pacific Insurance Group Co Ltd	420 122	0,07	215 500 HKD	Hengan International Group Co Ltd	801 721	0,14
134 399 HKD	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	125 130	0,02	182 000 HKD	Hisense Home Appliances Group Co Ltd	392 969	0,07
622 437 CNY	China State Construction Engineering Corp Ltd	420 459	0,07	400 000 CNY	HLA Group Corp Ltd	416 819	0,07
9 212 000 HKD	China Tower Corp Ltd	967 381	0,17	21 777 HKD	Horizon Construction Development Ltd	12 801	0,00
579 100 CNY	China United Network Communications Ltd	356 214	0,06	26 599 CNY	Huadong Medicine Co Ltd	154 874	0,03
277 600 HKD	China Vanke Co Ltd	256 677	0,05	97 600 CNY	Huaibei Mining Holdings Co Ltd	227 943	0,04
93 684 CNY	China Yangtze Power Co Ltd	307 079	0,05	75 100 CNY	Huayu Automotive Systems Co Ltd	171 703	0,03
26 441 CNY	Chongqing Zhifei Biological Products Co Ltd	226 920	0,04	207 600 CNY	Hubei Century Network Technology Co Ltd	460 938	0,08
1 896 000 HKD	CMOC Group Ltd	1 036 802	0,18	28 500 CNY	Hubei Jumpcan Pharmaceutical Co Ltd	125 798	0,02
22 894 CNY	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	524 910	0,09	43 700 CNY	Hubei Xingfa Chemicals Group Co Ltd	112 003	0,02
756 500 HKD	Cosco Shipping Holdings Co Ltd	760 516	0,13	410 600 CNY	Hunan Valin Steel Co Ltd	296 968	0,05
230 100 CNY	Cosco Shipping Holdings Co Ltd	309 575	0,05	56 800 HKD	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	256 775	0,05
292 000 HKD	CRRC Corp Ltd	128 638	0,02	2 981 000 HKD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	1 458 327	0,26
438 600 CNY	Daqin Railway Co Ltd	444 107	0,08	381 800 CNY	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	256 299	0,05
49 900 CNY	Dongfang Electric Corp Ltd	102 455	0,02	193 800 CNY	Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co Ltd	101 791	0,02
350 000 HKD	Dongyue Group Ltd	253 248	0,05	174 500 HKD	Innovent Biologics Inc	955 347	0,17
44 500 HKD	EEKA Fashion Holdings Ltd	80 810	0,01	126 700 HKD	JD Health International Inc	634 429	0,11
44 200 CNY	ENN Natural Gas Co Ltd	104 407	0,02	161 991 HKD	JD.com Inc	2 333 850	0,41
68 000 HKD	Everest Medicines Ltd	182 006	0,03	4 100 USD	JD.com Inc-ADR	118 449	0,02
405 500 CNY	Fanli Digital Technology Co Ltd	444 190	0,08	392 000 HKD	Jiangsu Expressway Co Ltd	352 414	0,06
107 500 USD	FinVolution Group-ADR	526 750	0,09	9 000 CNY	Jiangsu King's Luck Brewery JSC Ltd	61 617	0,01
288 400 CNY	Focus Media Information Technology Co Ltd	255 974	0,05	34 100 CNY	Jiangsu Yuyue Medical Equipment & Supply Co Ltd	165 601	0,03
102 930 CNY	Focus Technology Co Ltd	478 902	0,08	721 000 HKD	Jiangxi Copper Co Ltd	1 019 375	0,18
113 900 CNY	Foxconn Industrial Internet Co Ltd	241 857	0,04	344 757 CNY	Jointown Pharmaceutical Group Co Ltd	339 402	0,06
377 000 HKD	Fufeng Group Ltd	209 054	0,04	59 192 USD	JOYY Inc-ADR	2 349 922	0,42
14 100 USD	Full Truck Alliance Co Ltd	98 841	0,02	94 700 USD	Kanzhun Ltd	1 572 967	0,28
87 200 HKD	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd	424 355	0,08	43 800 USD	KE Holdings Inc	709 998	0,13
426 900 HKD	GDS Holdings Ltd	495 318	0,09	354 000 HKD	Kingsoft Cloud Holdings Ltd	91 123	0,02
464 908 HKD	Geely Automobile Holdings Ltd	511 434	0,09	159 000 HKD	Kingsoft Corp Ltd	490 731	0,09
315 500 HKD	Great Wall Motor Co Ltd	409 701	0,07	486 600 HKD	Kuaishou Technology	3 299 648	0,58
15 500 CNY	Gree Electric Appliances Inc of Zhuhai	70 027	0,01	5 900 CNY	Kweichow Moutai Co Ltd	1 430 132	0,25
85 200 CNY	Guangdong Provincial Expressway Development Co Ltd	101 226	0,02	182 000 CNY	LB Group Co Ltd	437 837	0,08
14 300 USD	H World Group Ltd-ADR	478 192	0,08	1 248 000 HKD	Lenovo Group Ltd	1 745 287	0,31
179 000 HKD	Haidilao International Holding Ltd	333 309	0,06	104 200 HKD	Li Auto Inc	1 962 953	0,35
113 513 CNY	Haier Smart Home Co Ltd	334 771	0,06	396 100 CNY	Lingyi iTech Guangdong Co	376 041	0,07
285 800 HKD	Haier Smart Home Co Ltd	807 050	0,14	37 468 CNY	Livzon Pharmaceutical Group Inc	184 220	0,03
122 700 CNY	Hangzhou Binjiang Real Estate Group Co Ltd	125 274	0,02	192 500 HKD	Longfor Group Holdings Ltd	308 156	0,05
7 600 CNY	Hangzhou Haoyue Personal Care Co Ltd	40 740	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets				
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)							
Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)							
Chine (suite)				Chine (suite)							
138 225 USD	Lufax Holding Ltd	424 351	0,08	216 912 CNY	TBEA Co Ltd	420 384	0,07				
175 000 CNY	Luxi Chemical Group Co Ltd	246 503	0,04	231 600 CNY	Tian Di Science & Technology Co Ltd	176 938	0,03				
3 900 CNY	Luzhou Laojiao Co Ltd	98 270	0,02	194 000 HKD	Tianli International Holdings Ltd	80 248	0,01				
181 100 CNY	Meihua Holdings Group Co Ltd	242 888	0,04	7 800 CNY	Tianqi Lithium Corp	61 113	0,01				
1 148 000 HKD	Meitu Inc	529 266	0,09	344 000 HKD	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	419 397	0,07				
359 000 HKD	Meituan	3 765 373	0,67	328 000 HKD	Tongdao Liepin Group	242 370	0,04				
70 000 HKD	MINISO Group Holding Ltd	359 926	0,06	95 000 HKD	Topsports International Holdings Ltd	73 970	0,01				
72 000 HKD	Minth Group Ltd	145 502	0,03	67 200 USD	Trip.com Group Ltd–ADR	2 419 872	0,43				
65 251 CNY	NARI Technology Co Ltd	204 534	0,04	110 000 HKD	Tsingtao Brewery Co Ltd	738 165	0,13				
196 625 HKD	NetEase Inc	3 540 411	0,63	31 500 USD	Tuya Inc–ADR	72 450	0,01				
300 000 CNY	New Guomai Digital Culture Co Ltd	483 246	0,09	641 000 HKD	Uni-President China Holdings Ltd	455 597	0,08				
201 600 HKD	New Oriental Education & Technology Group Inc	1 426 436	0,25	218 500 CNY	Visual China Group Co Ltd	451 079	0,08				
215 400 HKD	Nongfu Spring Co Ltd	1 245 469	0,22	497 000 HKD	Want Want China Holdings Ltd	300 419	0,05				
46 600 USD	PDD Holdings Inc–ADR	6 818 046	1,21	615 000 HKD	Weichai Power Co Ltd	1 027 028	0,18				
3 408 000 HKD	People's Insurance Co Group of China Ltd	1 047 467	0,19	137 800 CNY	Weichai Power Co Ltd	264 159	0,05				
1 173 849 HKD	PICC Property & Casualty Co Ltd	1 395 050	0,25	230 800 CNY	Western Mining Co Ltd	462 533	0,08				
625 000 HKD	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2 829 431	0,50	14 301 CNY	Wuliangye Yibin Co Ltd	281 798	0,05				
166 522 CNY	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	942 454	0,17	128 580 HKD	WuXi AppTec Co Ltd	1 308 269	0,23				
299 400 HKD	Pop Mart International Group Ltd	776 437	0,14	45 500 CNY	WuXi AppTec Co Ltd	464 930	0,08				
17 300 USD	Qifu Technology Inc	273 686	0,05	252 500 HKD	Wuxi Biologics Cayman Inc	957 156	0,17				
293 000 HKD	Qingdao Port International Co Ltd	158 722	0,03	1 747 000 HKD	Xiaomi Corp	3 490 174	0,62				
222 700 CNY	Satellite Chemical Co Ltd	461 313	0,08	221 000 HKD	Xinhua Winshare Publishing and Media Co Ltd	196 701	0,03				
282 600 CNY	Shanghai Construction Group Co Ltd	92 869	0,02	79 200 HKD	Xinte Energy Co Ltd	110 961	0,02				
419 200 CNY	Shanghai International Port Group Co Ltd	288 470	0,05	11 700 HKD	XPeng Inc	84 957	0,02				
2 CNY	Shanghai Lujiazui Finance & Trade Zone Development Co Ltd	2	0,00	486 000 HKD	Yadea Group Holdings Ltd	853 926	0,15				
403 800 HKD	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	590 557	0,10	51 307 CNY	Yunnan Yuntianhua Co Ltd	112 405	0,02				
185 490 CNY	Shanxi Lanhua Sci-Tech Venture Co Ltd	287 589	0,05	114 600 CNY	Yutong Bus Co Ltd	213 247	0,04				
3 260 CNY	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd	105 634	0,02	4 000 USD	Zai Lab Ltd	109 320	0,02				
27 000 CNY	Shenzhen Kingkey Smart Agriculture Times Co Ltd	69 390	0,01	97 500 HKD	Zai Lab Ltd	268 456	0,05				
6 300 CNY	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	257 110	0,05	52 300 CNY	Zangge Mining Co Ltd	186 119	0,03				
106 000 CNY	Sichuan Changhong Electric Co Ltd	78 749	0,01	42 700 CNY	Zhejiang Chint Electrics Co Ltd	128 989	0,02				
97 900 CNY	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd	399 404	0,07	275 639 CNY	Zhejiang Jiahua Energy Chemical Industry Co Ltd	332 520	0,06				
89 838 CNY	Sichuan Road and Bridge Group Co Ltd	94 499	0,02	521 900 USD	Zhihu Inc	488 707	0,09				
291 200 HKD	Sinopharm Group Co Ltd	762 631	0,14	314 400 HKD	ZTE Corp	702 196	0,12				
1 272 000 HKD	Sinotrans Ltd	532 678	0,09	27 900 CNY	ZTE Corp	103 754	0,02				
9 600 CNY	Sungrow Power Supply Co Ltd	118 089	0,02	33 300 USD	ZTO Express Cayman Inc–ADR	708 624	0,13				
36 900 CNY	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing Co Ltd	94 211	0,02	Chine – Total			130 349 685	23,09			
979 176 CNY	TangShan Port Group Co Ltd	481 296	0,09	Colombie			305 724	0,06			
				Colombie – Total				305 724	0,06		
				Chypre				2 376 USD	TCS Group Holding PLC–GDR*	0	0,00
				Chypre – Total				0	0,00		
				République tchèque				11 940 CZK	Komerční Banka AS	387 055	0,07
				République tchèque – Total				131 890 CZK	Moneta Money Bank AS	552 355	0,10
								939 410	0,17		

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)			
Égypte				Inde (suite)			
202 769	EGP Eastern Co SAE	111 072	0,02	2 488	INR Bajaj Holdings & Investment Ltd	229 462	0,04
Égypte – Total				263 829	INR Bank of Baroda	732 702	0,13
Grèce				376 250	INR Bharat Electronics Ltd	832 858	0,15
886	USD Danaos Corp	65 617	0,01	243 851	INR Bharat Petroleum Corp Ltd	1 320 593	0,23
14 701	EUR JUMBO SA	407 935	0,07	115 878	INR Bharti Airtel Ltd	1 437 374	0,25
43 265	EUR Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	1 135 554	0,20	21 537	INR Bombay Burmah Trading Co	407 453	0,07
20 758	EUR Mytilineos SA	841 543	0,15	44 434	INR Canara Bank	233 614	0,04
52 291	EUR OPAP SA	887 822	0,16	73 148	INR Castrol India Ltd	158 007	0,03
Grèce – Total				179 025	INR CG Power & Industrial Solutions Ltd	977 590	0,17
Hong Kong				64 000	INR Chennai Petroleum Corp Ltd	535 296	0,09
765 000	HKD CGN Mining Co Ltd	168 508	0,03	13 711	INR Colgate-Palmolive India Ltd	416 815	0,07
22 764	HKD China High Speed Transmission Equipment Group Co Ltd	4 752	0,00	24 194	INR Cyient Ltd	666 722	0,12
436 000	HKD China Overseas Land & Investment Ltd	768 306	0,14	11 448	INR DCM Shriram Ltd	141 481	0,03
140 000	HKD China Resources Beer Holdings Co Ltd	613 174	0,11	23 436	INR Dr Reddy's Laboratories Ltd	1 632 898	0,29
414 000	HKD China Resources Land Ltd	1 484 527	0,26	8 552	INR EID Parry India Ltd	57 233	0,01
218 000	HKD China Traditional Chinese Medicine Holdings Co Ltd	109 718	0,02	18 733	INR Finolex Cables Ltd	240 686	0,04
1 130 000	HKD CITIC Ltd	1 128 763	0,20	34 227	INR Fortis Healthcare Ltd	172 423	0,03
884 000	HKD CITIC Telecom International Holdings Ltd	371 326	0,07	815 553	INR GAIL India Ltd	1 588 693	0,28
588 000	HKD Far East Horizon Ltd	462 355	0,08	23 594	INR GHCL Ltd	164 734	0,03
1 472 000	HKD Kunlun Energy Co Ltd	1 327 120	0,23	52 256	INR Grasim Industries Ltd	1 340 597	0,24
208 500	HKD NetDragon Websoft Holdings Ltd	330 564	0,06	47 174	INR Great Eastern Shipping Co Ltd	553 749	0,10
670 756	HKD Shougang Fushan Resources Group Ltd	247 393	0,04	119 213	INR Gujarat Pipavav Port Ltd	219 261	0,04
322 303	HKD Sino Biopharmaceutical Ltd	143 226	0,03	48 768	INR Gujarat State Fertilizers & Chemicals Ltd	141 474	0,02
597 000	HKD Sinotruk Hong Kong Ltd	1 171 285	0,21	138 155	INR HCL Technologies Ltd	2 434 081	0,43
336 000	HKD United Laboratories International Holdings Ltd	301 639	0,05	19 957	INR HDFC Asset Management Co Ltd	768 649	0,14
176 000	HKD Wasion Holdings Ltd	88 354	0,02	164 899	INR HDFC Bank Ltd	3 387 104	0,60
933 399	HKD Yuexiu Property Co Ltd	760 246	0,13	266 223	INR Hindalco Industries Ltd	1 967 069	0,35
Hong-Kong – Total				46 846	INR Hindustan Aeronautics Ltd	1 578 539	0,28
Hongrie				71 478	INR Hindustan Petroleum Corp Ltd	342 643	0,06
133 154	HUF Magyar Telekom Telecommunications PLC	262 456	0,05	33 791	INR Hindustan Unilever Ltd	1 081 763	0,19
149 387	HUF MOL Hungarian Oil & Gas PLC	1 220 118	0,21	312 951	INR ICICI Bank Ltd	3 748 022	0,66
Hongrie – Total				14 305	INR Indian Bank	72 356	0,01
Inde				951 615	INR Indian Oil Corp Ltd	1 484 937	0,26
16 800	INR 360 ONE WAM LTD	143 311	0,03	20 918	INR Indo Count Industries Ltd	77 386	0,01
12 186	INR Apollo Hospitals Enterprise Ltd	835 321	0,15	72 706	INR Info Edge India Ltd	4 491 082	0,80
102 162	INR Apollo Tyres Ltd	557 440	0,10	296 662	USD Infosys Ltd-ADR	5 452 648	0,97
75 411	INR Arvind Ltd	236 934	0,04	403 888	INR ITC Ltd	2 242 858	0,40
18 572	INR Asian Paints Ltd	759 362	0,13	86 045	INR Jindal Steel & Power Ltd	773 553	0,14
27 502	INR Aster DM Healthcare Ltd	135 438	0,02	99 115	INR JSW Steel Ltd	1 048 456	0,19
86 901	INR Aurobindo Pharma Ltd	1 132 033	0,20	56 715	INR Just Dial Ltd	546 746	0,10
177 232	INR Axis Bank Ltd	2 347 723	0,42	22 771	INR Kaveri Seed Co Ltd	167 635	0,03
14 236	INR Bajaj Auto Ltd	1 162 857	0,21	36 587	INR Kotak Mahindra Bank Ltd	838 944	0,15
161 971	INR Bajaj Consumer Care Ltd	427 439	0,08	14 987	INR Lupin Ltd	238 267	0,04
12 110	INR Bajaj Finance Ltd	1 066 399	0,19	126 733	INR Mahindra & Mahindra Ltd	2 633 844	0,47
				288 122	INR Manappuram Finance Ltd	595 538	0,11
				2 697	INR Maruti Suzuki India Ltd	333 904	0,06
				87 733	INR Max Healthcare Institute Ltd	723 520	0,13
				6 904	INR Motilal Oswal Financial Services Ltd	102 950	0,02
				12 519	INR Muthoot Finance Ltd	222 100	0,04
				10 002	INR Narayana Hrudayalaya Ltd	144 470	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)			
Inde (suite)				Corée			
191 111	INR National Aluminium Co Ltd	303 040	0,05	7 040	KRW Aekyung Industrial Co Ltd	101 782	0,02
688 559	INR NHPC Ltd	534 538	0,09	8 239	KRW AfreecaTV Co Ltd	547 603	0,10
136 054	INR Oil India Ltd	608 463	0,11	214	KRW Chong Kun Dang Pharmaceutical Corp	21 751	0,00
5 634	INR Oracle Financial Services Software Ltd	285 228	0,05	23 954	KRW Connectwave Co Ltd	284 941	0,05
430 500	INR Petronet LNG Ltd	1 151 863	0,20	18 655	KRW DB Insurance Co Ltd	1 212 379	0,21
4 535	INR Polycab India Ltd	298 915	0,05	10 977	KRW Doosan Bobcat Inc	429 568	0,07
341 056	INR Power Finance Corp Ltd	1 568 107	0,28	1 833	KRW Ecopro BM Co Ltd	409 895	0,07
741 496	INR Power Grid Corp of India Ltd	2 113 627	0,37	920	KRW Ecopro Co Ltd	462 179	0,08
255 606	INR PTC India Ltd	583 773	0,10	25 010	KRW GS Holdings Corp	794 246	0,14
14 034	INR Raymond Ltd	290 609	0,05	43 549	KRW Hana Financial Group Inc	1 467 526	0,26
306 971	INR REC Ltd	1 522 981	0,27	19 024	KRW Hankook Tire & Technology Co Ltd	670 619	0,12
200 613	INR Reliance Industries Ltd	6 231 838	1,10	6 789	KRW Hanwha Aerospace Co Ltd	656 286	0,12
30 351	INR Shriram Finance Ltd	748 911	0,13	13 074	KRW HD Hyundai Co Ltd	642 584	0,11
5 354	INR Siemens Ltd	258 951	0,05	8 387	KRW Hyundai Glovis Co Ltd	1 247 077	0,22
58 278	INR Sonata Software Ltd	520 178	0,09	4 308	KRW Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	103 694	0,02
282 040	INR State Bank of India	2 176 128	0,39	7 581	KRW Hyundai Mobis Co Ltd	1 395 059	0,25
120 433	INR Sun Pharmaceutical Industries Ltd	1 822 768	0,32	16 664	KRW Hyundai Motor Co	2 633 065	0,47
19 673	INR Supreme Industries Ltd	1 074 023	0,19	307	KRW ISU SPECIALTY CHEMICAL	37 687	0,01
26 467	INR Tata Chemicals Ltd	351 171	0,06	52 302	KRW Kakao Corp	2 205 139	0,39
17 692	INR Tata Communications Ltd	376 382	0,07	54 858	KRW KB Financial Group Inc	2 304 385	0,41
38 590	INR Tata Motors Ltd	361 698	0,06	380	KRW KCC Corp	67 420	0,01
93 724	INR Tata Motors Ltd	584 890	0,10	78 725	KRW KG Chemical Corp	418 717	0,07
1 054 856	INR Tata Steel Ltd	1 769 634	0,31	12 998	KRW KG Eco Technology Service Co Ltd	113 741	0,02
87 827	INR Tech Mahindra Ltd	1 343 204	0,24	36 162	KRW Kia Corp	2 807 827	0,50
3 592	INR Titan Co Ltd	158 654	0,03	2 806	KRW Korea Electric Terminal Co Ltd	163 406	0,03
15 449	INR Torrent Pharmaceuticals Ltd	428 036	0,08	736	KRW Korea Investment Holdings Co Ltd	35 031	0,01
45 077	INR Torrent Power Ltd	505 868	0,09	5 643	KRW Korean Reinsurance Co	31 328	0,00
39 507	INR Triveni Turbine Ltd	201 372	0,04	9 805	KRW KT&G Corp	661 584	0,12
620	INR UltraTech Cement Ltd	78 255	0,01	9 207	KRW Kumho Petrochemical Co Ltd	950 082	0,17
56 669	INR Varun Beverages Ltd	842 335	0,15	1 542	KRW LG Chem Ltd	597 452	0,10
275 895	INR Vedanta Ltd	857 222	0,15	2 095	KRW LG Corp	139 732	0,02
2 289	INR Welspun India Ltd	3 973	0,00	7 629	KRW LG Electronics Inc	603 022	0,11
89 598	INR Wipro Ltd	507 459	0,09	460	KRW LG Energy Solution Ltd	152 690	0,03
12 453	INR Zensar Technologies Ltd	91 384	0,02	181 286	KRW Mirae Asset Securities Co Ltd	1 074 006	0,19
64 528	INR Zydus Lifesciences Ltd	534 439	0,09	24 598	KRW Naver Corp	4 278 245	0,76
Inde – Total		91 594 953	16,22	64 434	KRW NH Investment & Securities Co Ltd	516 813	0,09
Indonésie				1 846			
4 422 300	IDR Astra International Tbk PT	1 622 783	0,29	1 031	KRW OCI Holdings Co Ltd	152 221	0,03
3 536 300	IDR Bank Central Asia Tbk PT	2 158 941	0,38	4 167	KRW Orion Corp/Republic of Korea	92 941	0,02
972 400	IDR Bank CIMB Niaga Tbk PT	107 048	0,02	15 984	USD POSCO Holdings Inc	1 616 132	0,29
5 735 100	IDR Bank Mandiri Persero Tbk PT	2 253 514	0,40	11 761	KRW Posco International Corp	569 832	0,10
3 291 300	IDR Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	1 148 973	0,20	9 594	KRW Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	1 141 238	0,20
8 225 500	IDR Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	3 058 452	0,54	377 864	KRW Samsung Electronics Co Ltd	23 031 543	4,08
2 665 800	IDR Indofood Sukses Makmur Tbk PT	1 116 738	0,20	63 811	KRW Samsung Electronics Co Ltd–Preferred Stock	3 086 750	0,55
862 200	IDR Sumber Alfaria Trijaya Tbk PT	164 074	0,03	1 482	KRW Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	302 637	0,05
Indonésie – Total		11 630 523	2,06	2 644	KRW Samsung SDI Co Ltd	968 995	0,17
				5 823	KRW Samsung SDS Co Ltd	768 623	0,14

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)			
Corée (suite)				Mexique (suite)			
39 338	KRW Samsung Securities Co Ltd	1 175 955	0,21	68 000	MXN Fomento Economico Mexicano SAB de CV	887 419	0,16
52 511	KRW Shinhan Financial Group Co Ltd	1 637 019	0,29	49 460	MXN Gruma SAB de CV	908 736	0,16
6 711	USD Shinhan Financial Group Co Ltd-ADR	206 565	0,04	310 300	MXN Grupo Financiero Banorte SAB de CV	3 128 928	0,55
41 477	KRW SK Hynix Inc	4 557 027	0,81	38 200	MXN Grupo Mexico SAB de CV	212 447	0,04
6 553	KRW SK Telecom Co Ltd	254 915	0,04	232 500	MXN Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	524 050	0,09
48 066	KRW Woori Financial Group Inc	485 176	0,08	522 300	MXN Orbia Advance Corp SAB de CV	1 160 290	0,20
Corée – Total		71 806 368	12,72	156 800	MXN Wal-Mart de Mexico SAB de CV	662 681	0,12
Koweït				Mexique – Total			
100 609	KWD Gulf Cables & Electrical Industries Group Co. KSCP	428 959	0,08			15 656 889	2,77
198 736	KWD Kuwait Finance House KSCP	469 593	0,08	Philippines			
732 304	KWD Mobile Telecommunications Co KSCP	1 208 391	0,21	316 960	PHP International Container Terminal Services Inc	1 412 654	0,25
474 842	KWD National Bank of Kuwait SAKP	1 381 640	0,25	405 040	PHP Metropolitan Bank & Trust Co	375 233	0,07
Koweït – Total		3 488 583	0,62	16 030	PHP PLDT Inc	370 246	0,06
Luxembourg				128 390	PHP Robinsons Retail Holdings Inc	91 931	0,02
4 300	USD Ternium SA-ADR	182 621	0,03	Philippines – Total			
Luxembourg – Total		182 621	0,03			2 250 064	0,40
Malaisie				Pologne			
432 000	MYR Alliance Bank Malaysia Bhd	318 712	0,06	4 915	PLN Asseco Poland SA	91 369	0,02
300 295	MYR AMMB Holdings Bhd	262 064	0,05	3 096	PLN Bank Handlowy w Warszawie SA	79 836	0,01
627 042	MYR Bermaz Auto Bhd	322 050	0,06	43 968	PLN Bank Polska Kasa Opieki SA	1 700 130	0,30
3 083 300	MYR Bumi Armada Bhd	332 151	0,06	838	PLN Budimex SA	133 407	0,02
497 219	MYR CIMB Group Holdings Bhd	633 021	0,11	152 584	PLN Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	1 952 578	0,35
558 210	MYR Gamuda Bhd	557 603	0,10	26 659	PLN Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	320 471	0,06
133 000	MYR Genting Bhd	133 724	0,02	5 843	PLN Santander Bank Polska SA	727 802	0,13
66 600	MYR IOI Corp Bhd	56 961	0,01	Pologne – Total			
423 000	MYR Mah Sing Group Bhd	76 407	0,01			5 005 593	0,89
310 742	MYR Petronas Chemicals Group Bhd	484 203	0,09	Qatar			
34 400	MYR Petronas Gas Bhd	130 263	0,02	203 112	QAR Commercial Bank PSQC	331 919	0,06
316 700	MYR Public Bank Bhd	295 678	0,05	200 369	QAR Industries Qatar QSC	709 904	0,13
814 870	MYR RHB Bank Bhd	966 494	0,17	428 531	QAR Ooredoo QPSC	1 282 886	0,23
450 200	MYR Sime Darby Bhd	230 244	0,04	84 920	QAR Qatar International Islamic Bank QSC	245 827	0,04
401 000	MYR Sime Darby Plantation Bhd	389 219	0,07	304 194	QAR Qatar Islamic Bank SAQ	1 746 129	0,31
99 098	MYR Sports Toto Bhd	31 918	0,01	185 945	QAR Qatar National Bank QPSC	819 670	0,14
129 200	MYR Ta Ann Holdings Bhd	102 910	0,02	374 286	QAR Vodafone Qatar QSC	193 259	0,03
115 431	MYR Telekom Malaysia Bhd	139 422	0,02	Qatar – Total			
49 020	MYR TSH Resources Bhd	10 401	0,00			5 329 594	0,94
39 100	MYR United Plantations BHD	151 465	0,03	Russie			
1 019 600	MYR YTL Power International Bhd	563 609	0,10	1 504 048	RUB Gazprom PJSC*	0	0,00
Malaisie – Total		6 188 519	1,10	67 050	RUB LUKOIL PJSC*	0	0,00
Mexique				3 546	USD Novatek PJSC-GDR*	0	0,00
232 800	MXN Alfa SAB de CV	187 510	0,03	132 587	USD Severstal PAO-GDR*	0	0,00
146 200	MXN Alsea SAB de CV	553 910	0,10	30 841	USD X5 Retail Group NV-GDR*	0	0,00
646 058	MXN America Movil SAB de CV	600 487	0,11	21 304	USD Yandex NV*	0	0,00
139 096	MXN Arca Continental SAB de CV	1 522 914	0,27	3 878	USD Yandex NV*	0	0,00
383 300	MXN Banco del Bajío SA	1 285 626	0,23	Russie – Total			
260 600	USD Cemex SAB de CV-ADR	2 019 650	0,36			0	0,00
46 900	MXN Coca-Cola Femsa SAB de CV	445 806	0,08	Arabie saoudite			
862 200	MXN Fibra Uno Administracion SA de CV REIT	1 556 435	0,27	136 633	SAR Abdullah Al Othaim Markets Co	477 305	0,09
				11 329	SAR Al Hammadi Holding	180 358	0,03
				100 747	SAR Al Rajhi Bank	2 337 330	0,41

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)				
Arabie saoudite (suite)				Afrique du Sud (suite)				
6 046 SAR	Al-Dawaa Medical Services Co	170 255	0,03	39 883 ZAR	Super Group Ltd	64 881	0,01	
87 580 SAR	Alinma Bank	904 993	0,16	125 500 ZAR	Truworths International Ltd	510 235	0,09	
20 267 SAR	Almunajem Foods Co	390 748	0,07	7 074 ZAR	Wilson Bayly Holmes-Ovcon Ltd	50 310	0,01	
160 963 SAR	Arab National Bank	1 088 110	0,19	183 928 ZAR	Woolworths Holdings Ltd	726 157	0,13	
8 052 SAR	Arabian Contracting Services Co	508 886	0,09	Afrique du Sud – Total			16 153 684	2,86
2 690 SAR	Arabian Internet & Communications Services Co	248 341	0,04	Taiwan				
26 808 SAR	Arriyadh Development Co	150 268	0,03	16 000 TWD	Accton Technology Corp	272 658	0,05	
118 508 SAR	Banque Saudi Fransi	1 264 085	0,22	75 000 TWD	Acter Group Corp Ltd	433 766	0,08	
6 731 SAR	Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co	382 680	0,07	17 600 TWD	Addcn Technology Co Ltd	114 120	0,02	
4 593 SAR	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	347 598	0,06	490 000 TWD	ASE Technology Holding Co Ltd	2 155 390	0,38	
114 502 SAR	Etihad Etisalat Co	1 508 373	0,27	7 450 TWD	Asia Vital Components Co Ltd	81 684	0,01	
303 395 SAR	Mobile Telecommunications Co Saudi Arabia	1 142 383	0,20	37 000 TWD	Asustek Computer Inc	590 134	0,10	
12 128 SAR	National Medical Care Co	564 033	0,10	113 449 TWD	Cathay Financial Holding Co Ltd	169 117	0,03	
137 215 SAR	Riyad Bank	1 044 664	0,19	757 000 TWD	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	1 107 486	0,20	
47 434 SAR	SABIC Agri-Nutrients Co	1 748 101	0,31	92 486 TWD	Chicony Electronics Co Ltd	527 364	0,09	
114 543 SAR	Sahara International Petrochemical Co	1 040 050	0,19	118 000 TWD	Chicony Power Technology Co Ltd	559 424	0,10	
119 798 SAR	Saudi Awwal Bank	1 201 175	0,21	278 837 TWD	China Bills Finance Corp	137 190	0,02	
155 474 SAR	Saudi Electricity Co	786 077	0,14	39 000 TWD	Chipbond Technology Corp	91 875	0,02	
29 841 SAR	Saudi Investment Bank	126 526	0,02	11 716 USD	Chunghwa Telecom Co Ltd-ADR	457 744	0,08	
120 243 SAR	Saudi National Bank	1 240 908	0,22	2 604 968 TWD	CTBC Financial Holding Co Ltd	2 406 310	0,43	
255 004 SAR	Saudi Telecom Co	2 750 643	0,49	220 000 TWD	Delta Electronics Inc	2 247 275	0,40	
2 085 SAR	Saudia Dairy & Foodstuff Co	185 148	0,03	28 000 TWD	Depo Auto Parts Ind Co Ltd	134 113	0,02	
25 035 SAR	United International Transportation Co	525 401	0,09	1 221 000 TWD	Eva Airways Corp	1 251 216	0,22	
Arabie saoudite – Total			3,95	238 000 TWD	Far Eastern Department Stores Ltd	191 932	0,03	
				255 000 TWD	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	663 039	0,12	
				108 605 TWD	Farglory Land Development Co Ltd	200 999	0,04	
Singapour				1 362 041 TWD	First Financial Holding Co Ltd	1 216 009	0,22	
73 900 HKD	BOC Aviation Ltd	565 000	0,10	78 000 TWD	FSP Technology Inc	130 379	0,02	
Singapour – Total			0,10	952 331 TWD	Fubon Financial Holding Co Ltd	2 010 754	0,36	
Afrique du Sud				74 000 TWD	Gamania Digital Entertainment Co Ltd	178 427	0,03	
103 046 ZAR	Absa Group Ltd	922 469	0,16	102 000 TWD	Hannstar Board Corp	183 790	0,03	
21 937 ZAR	Bid Corp Ltd	511 793	0,09	1 146 740 TWD	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	3 904 607	0,69	
7 774 ZAR	Clicks Group Ltd	138 459	0,02	125 400 TWD	Kindom Development Co Ltd	158 739	0,03	
205 596 ZAR	FirstRand Ltd	826 431	0,15	214 000 TWD	King Yuan Electronics Co Ltd	591 994	0,11	
45 165 ZAR	Gold Fields Ltd	686 039	0,12	20 000 TWD	Largan Precision Co Ltd	1 870 286	0,33	
32 255 ZAR	Harmony Gold Mining Co Ltd	210 930	0,04	286 303 TWD	Lite-On Technology Corp	1 091 460	0,19	
66 821 ZAR	Investec Ltd	458 895	0,08	152 721 TWD	MediaTek Inc	5 050 808	0,89	
38 563 ZAR	Kumba Iron Ore Ltd	1 296 392	0,23	248 000 TWD	Mega Financial Holding Co Ltd	316 763	0,06	
267 140 ZAR	Momentum Metropolitan Holdings	319 765	0,06	15 000 TWD	Merry Electronics Co Ltd	53 518	0,01	
17 478 ZAR	Naspers Ltd	2 989 538	0,53	130 000 TWD	Micro-Star International Co Ltd	864 111	0,15	
382 668 ZAR	Old Mutual Ltd	273 282	0,05	22 000 TWD	MPI Corp	155 911	0,03	
106 828 ZAR	Omnia Holdings Ltd	381 864	0,07	29 000 TWD	Nan Pao Resins Chemical Co Ltd	265 522	0,05	
26 451 ZAR	Reunert Ltd	86 697	0,02	111 000 TWD	Novatek Microelectronics Corp	1 869 862	0,33	
263 674 ZAR	Sanlam Ltd	1 049 650	0,19	5 000 TWD	Parade Technologies Ltd	195 500	0,03	
68 804 ZAR	Sappi Ltd	166 296	0,03	382 000 TWD	Pegatron Corp	1 086 610	0,19	
102 225 ZAR	Shoprite Holdings Ltd	1 537 498	0,27	1 163 422 TWD	Pou Chen Corp	1 171 364	0,21	
394 285 ZAR	Sibanye Stillwater Ltd	536 853	0,09	13 000 TWD	President Chain Store Corp	114 156	0,02	
206 050 ZAR	Standard Bank Group Ltd	2 344 717	0,41	145 000 TWD	Primax Electronics Ltd	319 855	0,06	
28 784 ZAR	Sun International Ltd	64 533	0,01					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 97,14 % (suite)				
Taïwan (suite)				Émirats arabes unis (suite)				
251 000	TWD Quanta Computer Inc	1 836 057	0,33	447 109	AED Dubai Islamic Bank PJSC	696 335	0,12	
99 000	TWD Realtek Semiconductor Corp	1 520 943	0,27	305 894	AED Emaar Development PJSC	595 505	0,11	
76 000	TWD Shinkong Insurance Co Ltd	168 638	0,03	417 364	AED Emaar Properties PJSC	900 013	0,16	
28 000	TWD Simplo Technology Co Ltd	383 180	0,07	366 599	AED Emirates NBD Bank PJSC	1 726 816	0,31	
160 000	TWD Sinon Corp	200 453	0,04	64 786	AED Emirates Telecommunications Group Co PJSC	346 443	0,06	
180 118	TWD SinoPac Financial Holdings Co Ltd	115 616	0,02	57 919	AED First Abu Dhabi Bank PJSC	220 148	0,04	
130 000	TWD Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd	529 480	0,09	64 000	USD Yalla Group Ltd-ADR	392 320	0,07	
1 953 877	TWD Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	37 752 694	6,69	Émirats arabes unis – Total			7 518 319	1,33
298 000	TWD Teco Electric and Machinery Co Ltd	454 421	0,08	Royaume-Uni				
84 000	TWD Test Research Inc	171 610	0,03	77 913	USD VTEX	536 041	0,10	
166 000	TWD Unimicron Technology Corp	951 956	0,17	Royaume-Uni – Total			536 041	0,10
164 529	TWD Uni-President Enterprises Corp	399 388	0,07	États-Unis				
67 600	TWD United Integrated Services Co Ltd	582 597	0,10	47 400	HKD BeiGene Ltd	668 337	0,12	
986 000	TWD United Microelectronics Corp	1 689 891	0,30	10 900	USD Southern Copper Corp	938 163	0,16	
14 000	TWD Voltronic Power Technology Corp	780 046	0,14	20 875	USD Yum China Holdings Inc	885 726	0,16	
991 311	TWD Winbond Electronics Corp	983 543	0,17	États-Unis – Total			2 492 226	0,44
2 039 323	TWD Yuanta Financial Holding Co Ltd	1 833 965	0,32	Total des actions ordinaires et préférentielles			548 415 931	97,14
Taïwan – Total			15,40	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			548 415 931	97,14
Thaïlande				Autres valeurs mobilières				
135 000	THB Advanced Info Service PCL	858 273	0,15	Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 %				
1 859 600	THB AP Thailand PCL	615 644	0,11	Îles Caïmans				
108 200	THB Bangkok Bank PCL	496 105	0,09	1 608 600	HKD China Metal Recycling Holdings Ltd*	0	0,00	
347 900	THB Bangkok Dusit Medical Services PCL	282 846	0,05	Îles Caïmans – Total			0	0,00
706 200	THB Ichitan Group PCL	324 832	0,06	Chine				
554 800	THB Indorama Ventures PCL	442 930	0,08	639 000	HKD Trony Solar Holdings Co Ltd*	0	0,00	
96 800	THB Kasikornbank PCL	375 771	0,07	Chine – Total			0	0,00
195 700	THB Krung Thai Bank PCL	105 497	0,02	Hong Kong				
268 100	THB PTT Exploration & Production PCL	1 174 275	0,21	1 052 000	HKD Anxin-China Holdings Ltd*	0	0,00	
1 806 880	THB PTT PCL	1 892 506	0,33	4 826 100	HKD China Common Rich Renewable Energy Investments Ltd*	0	0,00	
608 800	THB Thai Oil PCL	958 705	0,17	1 256 500	HKD Real Gold Mining Ltd*	0	0,00	
354 900	THB Thanachart Capital PCL	514 687	0,09	53 542	HKD UntradeLumena Newmat*	0	0,00	
375 550	THB Tisco Financial Group PCL	1 097 520	0,19	Hong-Kong – Total			0	0,00
3 955 100	THB TMBThanachart Bank PCL	193 511	0,03	Mexique				
Thaïlande – Total			1,65	47 000	MXN Altos Hornos de Mexico SA de CV*	0	0,00	
Turquie				48 197	MXN Corporacion Chihuahua SA de CV*	0	0,00	
185 481	TRY Akbank TAS	229 355	0,04	50	MXN Corporacion Chihuahua SA de CV-Preferred Stock*	0	0,00	
54 838	TRY BIM Birlesik Magazalar AS	558 425	0,10	Mexique – Total			0	0,00
249 742	TRY KOC Holding AS	1 199 073	0,21	Russie				
52 658	TRY Tofas Turk Otomobil Fabrikasi AS	374 422	0,07	1 630 093	RUB Alrosa PJSC*	0	0,00	
30 320	TRY Turk Hava Yollari AO	234 684	0,04	2 609 068	RUB Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC*	0	0,00	
978 344	TRY Turkiye Is Bankasi AS	773 824	0,14	589 220	RUB Mobile TeleSystems PJSC*	0	0,00	
177 246	TRY Turkiye Petrol Rafinerileri AS	858 203	0,15	795 268	RUB Novolipetsk Steel PJSC*	0	0,00	
292 149	TRY Yapi ve Kredi Bankasi AS	193 289	0,03	102 971	USD PhosAgro PJSC-GDR*	0	0,00	
Turquie – Total			0,78	Émirats arabes unis				
Émirats arabes unis				438 274	AED Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	1 095 461	0,19	
357 731	AED Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	985 702	0,17	Émirats arabes unis – Total				
728 788	AED Air Arabia PJSC	559 576	0,10	7 518 319			1,33	

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Autres valeurs mobilières (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 % (suite)			
Russie (suite)			
663 USD	PHOSAGRO PJSC*	0	0,00
330 271 RUB	Rosneft Oil Co PJSC*	0	0,00
2 251 614 RUB	Sberbank of Russia PJSC*	0	0,00
4 388 317 439 RUB	VTB Bank PJSC*	0	0,00
Russie – Total		0	0,00
Total des actions ordinaires et préférentielles		0	0,00
Total des autres valeurs mobilières		0	0,00
TOTAL DES INVESTISSEMENTS		548 415 931	97,14

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,10 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	272	14 058 320	599 932	0,10
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés				599 932	0,10
Total des contrats à terme standardisés				599 932	0,10
Autres actifs/(passifs) nets				15 560 025	2,76
TOTAL DES ACTIFS NETS				564 575 888	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut (175 995 USD) détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

* Le Conseil d'administration a décidé de fixer le prix du titre à 0,00 conformément aux procédures d'évaluation des investissements en vigueur.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,36 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,36 % <i>(suite)</i>				
Autriche				France (suite)				
381	EUR BAWAG Group AG	18 281	0,07	4 133	EUR SCOR SE	109 359	0,41	
4 736	EUR Kontron AG	101 824	0,39	122	EUR SEB SA	13 786	0,05	
886	EUR Porr Ag	11 252	0,04	1 087	EUR Societe BIC SA	68 318	0,26	
4 415	EUR Wienerberger AG	133 421	0,50	3 391	EUR Sodexo SA	337 811	1,27	
Autriche – Total			1,00	841	EUR Sopra Steria Group SACA	166 350	0,63	
Belgique				3 310	EUR Spie SA	93 673	0,35	
1 521	EUR Bekaert SA	70 757	0,27	6 325	EUR Technip Energies NV	133 837	0,50	
1 386	EUR Colruyt Group N.V	56 549	0,21	17 823	EUR TotalEnergies SE	1 097 897	4,14	
2 118	EUR Fagron	35 180	0,13	625	EUR Trigano SA	92 687	0,35	
804	EUR KBC Ancora	33 382	0,13	489	EUR Veolia Environnement SA	13 966	0,05	
256	EUR Retail Estates NV REIT	16 537	0,06	3 027	EUR Verallia SA	105 521	0,40	
2 187	EUR Solvay SA	60 645	0,23	1 008	EUR Vicat SACA	33 113	0,13	
2 187	EUR Syensqo SA	206 147	0,78	France – Total			9 232 464	34,78
3 409	EUR X-Fab Silicon Foundries SE	34 704	0,13	Allemagne				
Belgique – Total			1,94	2 945	EUR Allianz SE	712 543	2,68	
Finlande				5 579	EUR Bayerische Motoren Werke AG	562 252	2,12	
3 525	EUR Kemira Oyj	59 185	0,22	292	EUR Bayerische Motoren Werke AG–Preferred Stock	26 265	0,10	
4 452	EUR Konecranes Oyj	181 553	0,68	1 616	EUR Bilfinger SE	56 269	0,21	
14 480	EUR Outokumpu Oyj	64 928	0,25	132	EUR Cewe Stiftung & Co KGAA	13 358	0,05	
3 918	EUR Puuilo Oyj	34 968	0,13	2 225	EUR Commerzbank AG	23 941	0,09	
1 012	EUR Tokmanni Group Corp	14 795	0,06	1 230	EUR CompuGroup Medical SE & Co KGaA	46 617	0,18	
Finlande – Total			1,34	44 219	EUR Deutsche Bank AG	546 724	2,06	
France				9 438	EUR Deutsche Post AG	423 341	1,60	
553	EUR Air Liquide SA	97 394	0,37	25 476	EUR Deutsche Telekom AG	554 103	2,09	
6 694	EUR AXA SA	197 406	0,74	4 329	EUR Deutz AG	20 779	0,08	
5 864	EUR BNP Paribas SA	367 028	1,38	272	EUR Draegerwerk AG & Co KGaA–Preferred Stock	14 090	0,05	
1 083	EUR Carmila SA REIT	16 873	0,06	604	EUR Elmos Semiconductor SE	44 696	0,17	
27 475	EUR Carrefour SA	455 123	1,72	10 214	EUR EON SE	124 100	0,47	
8 891	EUR Cie de Saint-Gobain SA	592 674	2,23	335	EUR Fielmann Group AG	16 294	0,06	
1 114	EUR Cie des Alpes	15 730	0,06	9 933	EUR Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	377 057	1,42	
16 027	EUR Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	520 236	1,96	15 331	EUR Fresenius SE & Co KGaA	430 341	1,62	
4 539	EUR Coface SA	53 742	0,20	1 230	EUR FUCHS SE	49 569	0,19	
3 227	EUR Eiffage SA	313 084	1,18	1 303	EUR Gerresheimer AG	122 938	0,46	
11 138	EUR Elis SA	210 397	0,79	5 796	EUR Heidelberg Materials AG	469 128	1,77	
22 953	EUR Engie SA	365 366	1,38	73	EUR Stock	5 319	0,02	
9 607	EUR Etablissements Maurel et Prom SA	58 507	0,22	1 157	EUR Hugo Boss AG	78 051	0,29	
350	EUR Eurazeo SE	25 147	0,10	348	EUR JOST Werke SE	15 382	0,06	
10 931	EUR Forvia SE	223 211	0,84	106	EUR Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	39 761	0,15	
126	EUR Hermes International SCA	241 769	0,91	2 344	EUR SAF-Holland SE	35 629	0,13	
2 508	EUR Ipsen SA	270 613	1,02	7 062	EUR SAP SE	985 008	3,71	
881	EUR L'Oreal SA	397 023	1,50	2 279	EUR Siemens AG	387 248	1,46	
942	EUR LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	691 051	2,60	561	EUR Siltronic AG	49 620	0,19	
707	EUR Metropole Television SA	9 149	0,03	88	EUR Stabilus SE	5 430	0,02	
8 839	EUR Pierre Et Vacances SA	13 718	0,05	3 425	EUR Suedzucker AG	48 601	0,18	
6 171	EUR Publicis Groupe SA	518 364	1,95	14 587	EUR TeamViewer SE	205 093	0,77	
1 659	EUR Quadient SA	31 886	0,12					
8 515	EUR Rexel SA	210 917	0,80					
10 650	EUR Sanofi SA	955 944	3,60					
626	EUR Schneider Electric SE	113 794	0,43					

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,36 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,36 % (suite)			
Allemagne (suite)				Portugal			
5 151	EUR thyssenkrupp AG	32 513	0,12	16 703	EUR Mota-Engil SGPS SA	66 144	0,25
502	EUR Wacker Neuson SE	9 166	0,03	57 860	EUR Sonae SGPS SA	52 334	0,20
Allemagne – Total				Portugal – Total			
6 531 226				118 478			
24,60				0,45			
Irlande				Espagne			
5 800	USD AerCap Holdings NV	390 220	1,47	7 386	EUR Acerinox SA	78 698	0,30
20 959	EUR Cairn Homes PLC	27 708	0,10	11 449	EUR ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	459 792	1,73
12 551	EUR Glanbia PLC	187 135	0,71	79 640	EUR Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	655 119	2,47
5 096	EUR Glenveagh Properties PLC	6 217	0,02	171 114	EUR Banco Santander SA	646 725	2,43
1 994	EUR Origin Enterprises PLC	6 859	0,03	4 218	EUR Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	103 257	0,39
Irlande – Total				Espagne – Total			
618 139				2 738 152			
2,33				10,31			
Italie				Suisse			
104 154	EUR A2A SpA	193 622	0,73	336	EUR CIE Automotive SA	8 642	0,03
488	EUR Banca IFIS SpA	7 662	0,03	9 135	EUR Gestamp Automocion SA	32 045	0,12
1 296	EUR Buzzi SpA	35 692	0,13	14 033	EUR Indra Sistemas SA	196 462	0,74
1 702	EUR Cementir Holding NV	16 237	0,06	3 238	EUR Industria de Diseno Textil SA	127 674	0,48
681	EUR De' Longhi SpA	20 784	0,08	2 645	EUR Lar Espana Real Estate Socimi SA REIT	16 267	0,06
55 105	EUR Enel SpA	370 857	1,40	1 680	EUR Neinor Homes SA	17 741	0,07
8 753	EUR Hera SpA	26 014	0,10	111 978	EUR Telefonica SA	395 730	1,49
111 061	EUR Intesa Sanpaolo SpA	293 590	1,11	Suisse – Total			
67 810	EUR Iren SpA	133 789	0,50	559 771			
21 980	EUR Iveco Group NV	179 049	0,67	2,11			
24 520	EUR UniCredit SpA	602 334	2,27	Suisse – Total			
34 712	EUR Unipol Gruppo SpA	179 183	0,68	559 771			
Italie – Total				Royaume-Uni			
2 058 813				7,76			
Pays-Bas				Royaume-Uni			
1 564	EUR ASML Holding NV	1 066 179	4,02	4 000	USD Coca-Cola Europacific Partners PLC	241 669	0,91
56	EUR EXOR NV	5 068	0,02	Royaume-Uni – Total			
45 939	EUR ING Groep NV	621 371	2,34	241 669			
7 856	EUR Koninklijke Ahold Delhaize NV	204 374	0,77	0,91			
14 464	EUR Koninklijke BAM Groep NV	34 974	0,13	Total des actions ordinaires et préférentielles			
2 202	EUR Koninklijke KPN NV	6 866	0,02	26 373 694			
2 247	EUR Koninklijke Philips NV	47 378	0,18	99,36			
31 146	EUR Stellantis NV	658 738	2,48	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
2 347	EUR Van Lanschot Kempen NV	66 068	0,25	26 373 694			
3 340	EUR Wolters Kluwer NV	429 858	1,62	99,36			
Pays-Bas – Total				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
3 140 874				26 373 694			
11,83				99,36			
Produits dérivés							
Contrats à terme standardisés – (0,01) %							
Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Moins-values latentes	% des actifs nets		
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE, due 15/03/24	EUR	3	136 290	(1 500)	(0,01)		
Moins-values latentes sur contrats à terme standardisés			136 290	(1 500)	(0,01)		
Total des contrats à terme standardisés			136 290	(1 500)	(0,01)		
Autres actifs/(passifs) nets				172 499	0,65		
TOTAL DES ACTIFS NETS				26 544 693	100,00		

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 11 743 EUR détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Fonds communs de placement – 0,33 %				Actions ordinaires et préférentielles – 98,32 % <i>(suite)</i>			
Royaume-Uni				France (suite)			
94 376	USD BioPharma Credit PLC Fund, zero coupon	71 766	0,33	5 823	EUR Technip Energies NV	123 215	0,57
Royaume-Uni – Total				556	EUR Trigano SA	82 455	0,38
Total des fonds communs de placement				France – Total			
71 766				1 652 340			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,32 %				Géorgie			
Autriche				641			
24 966	CHF ams-OSRAM AG	56 767	0,26	GBP Bank of Georgia Group PLC			
2 989	EUR BAWAG Group AG	143 412	0,66	770			
8 055	EUR Kontron AG	173 182	0,79	GBP TBC Bank Group PLC			
6 905	EUR Porr Ag	87 694	0,40	Géorgie – Total			
9 096	EUR Raiffeisen Bank International AG	169 822	0,78	54 552			
1 973	GBP Rhi Magnesita NV	78 781	0,36	Allemagne			
9 658	EUR Wienerberger AG	291 865	1,34	4 433			
Autriche – Total				EUR Bilfinger SE			
1 001 523				1 143			
Belgique				EUR Cewe Stiftung & Co KGAA			
5 421	EUR Bekaert SA	252 185	1,15	1 391			
410	EUR Fagron	6 810	0,03	EUR Cliq Digital AG			
5 895	EUR KBC Ancora	244 760	1,12	1 007			
5 029	EUR Proximus SADP	42 797	0,20	EUR CompuGroup Medical SE & Co KGaA			
3 424	EUR Retail Estates NV REIT	221 190	1,01	1 025			
17 088	EUR X-Fab Silicon Foundries SE	173 956	0,80	EUR Draegerwerk AG & Co KGaA–Preferred Stock			
Belgique – Total				1 203			
941 698				EUR Elmos Semiconductor SE			
Danemark				1 168			
1 258	SEK Better Collective A/S	28 985	0,13	EUR Gerresheimer AG			
42 835	DKK H Lundbeck A/S	188 244	0,86	427			
130	DKK Pandora A/S	16 274	0,08	EUR GFT Technologies SE			
5 164	DKK Per Aarsleff Holding A/S	223 406	1,02	910			
5 004	DKK Spar Nord Bank A/S	71 557	0,33	EUR Northern Data AG			
6 137	DKK Sydbank AS	241 707	1,11	15 481			
Danemark – Total				EUR SAF-Holland SE			
770 173				268			
Finlande				EUR Salzgitter AG			
778	EUR Cargotec Oyj	41 001	0,19	1 640			
3 299	EUR Kemira Oyj	55 390	0,25	EUR Siltronic AG			
1 435	EUR Konecranes Oyj	58 519	0,27	36 689			
5 739	EUR Puuilo Oyj	51 221	0,24	GBP Sirius Real Estate Ltd			
Finlande – Total				106			
206 131				EUR SMA Solar Technology AG			
France				1 623			
15 612	EUR Carmila SA REIT	243 235	1,11	EUR SUESS MicroTec SE			
1 910	EUR Cie des Alpes	26 969	0,12	14 432			
1 311	EUR Coface SA	15 522	0,07	EUR TAG Immobilien AG			
4 589	EUR Elis SA	86 686	0,40	11 669			
1 595	EUR Eurazeo SE	114 601	0,53	EUR TeamViewer SE			
13 878	EUR Forvia SE	283 389	1,30	10 640			
1 919	EUR Jacquet Metals SACA	37 612	0,17	EUR thyssenkrupp AG			
819	EUR Lagardere SA	15 053	0,07	520			
6 460	EUR Metropole Television SA	83 592	0,38	EUR Traton SE			
6 662	EUR Pierre Et Vacances SA	10 340	0,05	2 571			
5 587	EUR Quadiant SA	107 382	0,49	EUR United Internet AG			
13 142	EUR Rexel SA	325 527	1,49	Allemagne – Total			
1 347	EUR SCOR SE	35 642	0,16	1 596 574			
309	EUR Sopra Steria Group SACA	61 120	0,28	Irlande			
France – Total				24 893			
1 636 055				GBP Grafton Group PLC			
Israël				Irlande – Total			
10 528				261 734			
GBP Plus500 Ltd				261 734			
Israël – Total				1,20			
202 048				Israël			
0,93				10 528			
0,93				GBP Plus500 Ltd			
202 048				Israël – Total			
0,93				202 048			
0,93				Italie			
1 636 055				139 718			
7,49				EUR A2A SpA			
Italie				83 106			
139 718				EUR Arnoldo Mondadori Editore SpA			
EUR A2A SpA				12 858			
259 736				EUR Banca IFIS SpA			
1,19				20 029			
83 106				EUR Banco BPM SpA			
178 262				24 067			
0,82				EUR Cementir Holding NV			
12 858				20 121			
EUR Banca IFIS SpA				EUR Hera SpA			
201 871				59 714			
0,92				EUR Iren SpA			
20 029				20 465			
EUR Banco BPM SpA				EUR Iveco Group NV			
95 759				6 565			
0,44				EUR Orsero SpA			
24 067				41 682			
EUR Cementir Holding NV				EUR Unipol Gruppo SpA			
229 599				215 162			
1,05				0,99			
20 121				Italie – Total			
EUR Hera SpA				1 636 055			
59 800				7,49			
0,27				139 718			
59 714				EUR A2A SpA			
117 816				259 736			
0,54				1,19			
20 465				83 106			
EUR Iveco Group NV				EUR Arnoldo Mondadori Editore SpA			
166 708				178 262			
0,76				12 858			
6 565				EUR Banca IFIS SpA			
111 342				201 871			
0,51				20 029			
41 682				EUR Banco BPM SpA			
215 162				95 759			
0,99				24 067			
Italie – Total				1 636 055			
7,49				7,49			

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,32 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,32 % (suite)			
Jordanie				Espagne (suite)			
4 273	GBP Hikma Pharmaceuticals PLC	88 219	0,40	36 802	EUR Lar Espana Real Estate Socimi SA REIT	226 332	1,04
Jordanie – Total				Espagne – Total			
88 219 0,40				859 838 3,94			
Luxembourg				Suède			
14 794	EUR Arountown SA	36 615	0,17	4 551	EUR Neinor Homes SA	48 059	0,22
Luxembourg – Total				14 430	EUR Tubacex SA	50 505	0,23
36 615 0,17				Espagne – Total			
Pays-Bas				Suède			
1	EUR Aegon Ltd	5	0,00	5 521	SEK AddLife AB	54 255	0,25
815	EUR BE Semiconductor Industries NV	111 207	0,51	10 266	SEK Ambea AB	48 506	0,22
198	EUR Eurocommercial Properties NV REIT	4 395	0,02	16 833	SEK Arjo AB	59 575	0,27
11 808	EUR Koninklijke BAM Groep NV	28 552	0,13	4 869	SEK Attendo AB	15 789	0,07
3 516	EUR MFE-MediaForEurope NV	11 487	0,05	22 060	SEK Betsson AB	215 002	0,98
152	EUR Signify NV	4 609	0,02	1 862	SEK Bure Equity AB	47 802	0,22
7 641	EUR Van Lanschot Kempen NV	215 094	0,99	65 375	SEK Corem Property Group AB	62 366	0,28
588	EUR Wereldhave NV REIT	8 502	0,04	5 027	SEK Dometic Group AB	40 695	0,19
Pays-Bas – Total				34 598	SEK Elekta AB	255 837	1,17
383 851 1,76				11 148	SEK Enad Global 7 AB	18 926	0,09
Norvège				1 163	SEK G5 Entertainment AB	16 276	0,07
22 153	NOK Aker Solutions ASA	82 976	0,38	14 667	SEK Granges AB	152 829	0,70
5 815	NOK Atea ASA	66 970	0,31	4 468	SEK Hanza AB	34 235	0,16
14 244	NOK B2 Impact ASA	9 332	0,04	25 447	SEK Hexpol AB	278 871	1,28
17 643	NOK Belships ASA	28 906	0,13	10 426	SEK Inwido AB	126 620	0,58
2 125	NOK Elmera Group ASA	5 721	0,03	7 336	SEK Lindab International AB	131 201	0,60
12 360	NOK Hoegh Autoliners ASA	101 637	0,47	8 703	SEK Loomis AB	209 200	0,96
2 416	NOK Klaveness Combination Carriers ASA	18 736	0,09	15 777	SEK Modern Times Group MTG AB	122 092	0,56
5 988	NOK MPC Container Ships ASA	7 112	0,03	1 835	SEK Mycronic AB	47 373	0,22
22 743	NOK Odfjell Drilling Ltd	79 875	0,37	19 201	SEK Nyfosa AB	165 319	0,76
1 772	NOK Pexip Holding ASA	4 091	0,02	12 193	SEK Rvrc Holding AB	65 990	0,30
16 683	NOK Rana Gruber ASA	118 819	0,54	25 879	SEK SSAB AB	178 657	0,82
168	NOK Schibsted ASA	4 142	0,02	7 134	SEK Trelleborg AB	216 343	0,99
7 691	NOK SpareBank 1 Nord Norge	70 750	0,32	32 421	SEK Wihlborgs Fastigheter AB	274 483	1,26
1 020	NOK Veidekke ASA	9 292	0,04	Suède – Total			2 838 242 13,00
Norvège – Total				Suisse			
608 359 2,79				134 532	CHF Aryzta AG	224 575	1,03
Portugal				9 030	CHF Ascom Holding AG	79 837	0,36
123 865	EUR Banco Comercial Portugues SA	33 988	0,15	2 859	CHF Bellevue Group AG	75 340	0,34
11 304	EUR NOS SGPS SA	36 173	0,17	597	CHF BKW AG	95 997	0,44
Portugal – Total				3 892	GBP Coca-Cola HBC AG	103 529	0,47
70 161 0,32				394	CHF dormakaba Holding AG	192 396	0,88
Singapour				20 049	CHF EFG International AG	232 895	1,07
15 585	NOK BW LPG Ltd	210 190	0,96	89	CHF Intershop Holding AG	58 872	0,27
15 971	NOK Hafnia Ltd	99 939	0,46	1 213	CHF Logitech International SA	104 061	0,48
Singapour – Total				1 076	CHF Medacta Group SA	145 360	0,67
310 129 1,42				2 674	CHF Medmix AG	54 646	0,25
Afrique du Sud				159	CHF Siegfried Holding AG	146 990	0,67
6 126	GBP Investec PLC	37 596	0,17	1 806	CHF Zehnder Group AG	103 924	0,48
Afrique du Sud – Total				Suisse – Total			1 618 422 7,41
37 596 0,17				Royaume-Uni			
Espagne				1 219	GBP 4imprint Group PLC	64 289	0,29
2 282	EUR ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	91 645	0,42	20 688	GBP B&M European Value Retail SA	133 745	0,61
6 264	EUR Aedas Homes SA	114 130	0,52	62 771	GBP Balfour Beatty PLC	239 920	1,10
53 747	EUR Banco de Sabadell SA	59 820	0,27	2 629	GBP Britvic PLC	25 500	0,12
21 096	EUR Gestamp Automocion SA	74 005	0,34	84 876	GBP Card Factory PLC	105 589	0,48
13 953	EUR Indra Sistemas SA	195 342	0,90				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Actions ordinaires et préférentielles – 98,32 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,32 % (suite)					
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)					
91 736	GBP ConvaTec Group PLC	258 525	1,18	51 230	GBP Pets at Home Group Plc	188 123	0,86		
10 301	GBP DFS Furniture PLC	14 479	0,07	28 747	GBP Polar Capital Holdings PLC	154 595	0,71		
31 292	GBP Domino's Pizza Group PLC	136 070	0,62	51 848	GBP Premier Foods PLC	81 135	0,37		
38 923	GBP DS Smith PLC	138 034	0,63	53 865	GBP Redde Northgate PLC	225 958	1,04		
18 068	GBP Dunelm Group PLC	228 736	1,05	6 474	GBP Serco Group PLC	12 111	0,06		
5 258	GBP easyJet PLC	30 946	0,14	6 975	GBP Spectris PLC	304 185	1,39		
108 557	GBP Firstgroup PLC	219 237	1,00	7 131	NOK Stolt-Nielsen Ltd	198 004	0,91		
214 918	GBP Foxtons Group PLC	114 090	0,52	7 851	GBP Triple Point Social Housing Reit	5 726	0,03		
10 294	GBP Galliford Try Holdings PLC	26 729	0,12		PLC REIT				
623	GBP Games Workshop Group PLC	70 961	0,33	62 146	GBP Tyman PLC	225 554	1,03		
66 149	GBP Hammerson PLC REIT	21 680	0,10	45 042	GBP Vesuvius PLC	250 127	1,15		
2 211	GBP Hill & Smith PLC	48 684	0,22	53 433	GBP Virgin Money UK PLC	101 405	0,46		
33 972	GBP Howden Joinery Group PLC	318 970	1,46	37 170	GBP Wickes Group PLC	60 954	0,28		
1 307	GBP IMI PLC	25 400	0,12	35 149	GBP Workspace Group PLC REIT	230 398	1,06		
26 959	GBP Inchcape PLC	222 603	1,02	2 202	GBP YouGov PLC	29 986	0,14		
4 533	GBP Intermediate Capital Group PLC	87 911	0,40	Royaume-Uni – Total			6 290 493	28,81	
6 281	GBP J D Wetherspoon PLC	58 749	0,27	Total des actions ordinaires et préférentielles			21 464 753	98,32	
10 183	GBP JET2 PLC	146 776	0,67						
140 880	GBP Johnson Service Group PLC	230 213	1,06	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				21 536 519	98,65
4 299	GBP Keller Group PLC	43 658	0,20	Autres valeurs mobilières					
140 201	GBP Kier Group PLC	173 445	0,79	Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 %					
6 852	GBP Liontrust Asset Management PLC	49 817	0,23	Suisse					
75 379	GBP Luceco PLC	107 867	0,49	3 026 CHF Petroplus Holdings AG*				0	0,00
10 330	GBP Man Group PLC	27 729	0,13	Suisse – Total				0	0,00
50 107	GBP Marks & Spencer Group PLC	1 515 75	0,72	Total des actions ordinaires et préférentielles				0	0,00
196 288	GBP Mitie Group PLC	224 937	1,03	Total des autres valeurs mobilières				0	0,00
22 349	GBP Moneysupermarket.com Group PLC	72 268	0,33	TOTAL DES INVESTISSEMENTS				21 536 519	98,65
2 933	GBP Morgan Sindall Group PLC	74 973	0,34						
23 880	GBP OSB Group PLC	128 036	0,59						
24 120	GBP Paragon Banking Group PLC	194 151	0,89						

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – 0,03 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
EURO STOXX SM FUTURE, due 15/03/24	EUR	12	199 320	6 060	0,03
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés				6 060	0,03
Total des contrats à terme standardisés				6 060	0,03
Autres actifs/(passifs) nets				288 856	1,32
TOTAL DES ACTIFS NETS				21 831 435	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 7 812 EUR détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

* Le Conseil d'administration a décidé de fixer le prix du titre à 0,00 conformément aux procédures d'évaluation des investissements en vigueur.

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Fonds communs de placement – 4,85 %				Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % <i>(suite)</i>			
Irlande				Chili			
130 879	USD iShares MSCI EM Small Cap UCITS ETF, zero coupon,	11 342 628	4,85	24 506	CLP CAP SA	202 045	0,09
Irlande – Total				1 659 723	CLP Colbun SA	265 697	0,11
Total des fonds communs de placement				175 948	CLP Embotelladora Andina SA–Preferred Stock	441 237	0,19
Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 %				103 740	CLP Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA	382 834	0,16
Bermudes				297 765	CLP Inversiones Aguas Metropolitanas SA	250 355	0,11
716 000	HKD Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	389 701	0,17	1 493 947	CLP SMU SA	276 795	0,12
Bermudes – Total				Chili – Total			
11 342 628				1 818 963			
Brésil				Chine			
81 600	BRL Bradespar SA–Preferred Stock	431 047	0,18	134 000	HKD 3SBio Inc	129 048	0,05
116 700	BRL Camil Alimentos SA	203 005	0,09	360 000	HKD AK Medical Holdings Ltd	288 607	0,12
38 100	BRL Cia de Ferro Ligas da Bahia FERBASA–Preferred Stock	364 639	0,16	464 000	HKD Anhui Expressway Co Ltd	457 550	0,20
63 400	BRL Cia de Saneamento de Minas Gerais Copasa MG	267 299	0,11	692 000	HKD Beijing Jingneng Clean Energy Co Ltd	153 314	0,07
96 200	BRL Cia De Sanena Do Parana	578 079	0,25	132 000	HKD Chaowei Power Holdings Ltd	24 343	0,01
196 400	BRL Cia De Sanena Do Parana–Preferred Stock	238 142	0,10	606 000	HKD China BlueChemical Ltd	152 886	0,07
196 700	BRL Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes	975 077	0,42	1 614 096	HKD China Datang Corp Renewable Power Co Ltd	372 076	0,16
68 250	BRL Fleury SA	253 465	0,11	232 500	HKD China East Education Holdings Ltd	79 797	0,03
46 600	BRL Iochpe Maxion SA	123 657	0,05	179 000	HKD China Lilang Ltd	96 967	0,04
328 200	BRL JHSF Participacoes SA	376 333	0,16	436 000	HKD China New Higher Education Group Ltd	118 931	0,05
90 400	BRL Kepler Weber SA	203 407	0,09	1 337 000	HKD China Nonferrous Mining Corp Ltd	878 372	0,38
46 400	BRL LOG Commercial Properties e Participacoes SA	217 787	0,09	718 000	HKD China Resources Medical Holdings Co Ltd	443 201	0,19
100 622	BRL Mahle Metal Leve SA	732 045	0,31	177 000	HKD China Shineway Pharmaceutical Group Ltd	164 792	0,07
84 500	BRL Marcopolo SA–Preferred Stock	122 638	0,05	304 000	HKD Excellence Commercial Property & Facilities Management Group Ltd	62 291	0,03
589 800	BRL Metalurgica Gerdau SA–Preferred Stock	1 318 599	0,56	87 200	USD FinVolution Group–ADR	427 280	0,18
52 900	BRL Minerva SA	81 349	0,03	1 352 000	HKD Fufeng Group Ltd	749 711	0,32
151 750	BRL Odontoprev SA	363 005	0,16	498 000	HKD Harbin Electric Co Ltd	132 017	0,06
609 600	BRL Randon SA Implementos e Participacoes	1 606 324	0,69	102 500	USD Hello Group Inc	712 375	0,30
80 500	BRL Sao Martinho S/A	485 724	0,21	1 803 000	HKD Lonking Holdings Ltd	281 699	0,12
84 400	BRL Schulz SA–Preferred Stock	122 493	0,05	812 500	HKD Luye Pharma Group Ltd	388 116	0,17
276 406	BRL SLC Agricola SA	1 070 891	0,46	52 400	HKD Midea Real Estate Holding Ltd	36 036	0,02
88 900	BRL Tupy SA	532 200	0,23	61 500	HKD SciClone Pharmaceuticals Holdings Ltd	109 634	0,05
53 910	BRL Unipar Carbocloro SA–Preferred Stock	850 001	0,36	1 780 000	HKD Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd	148 171	0,06
Brésil – Total				1 818 963			
11 517 206				4,92			
Îles Caïmans				Chine			
339 000	HKD Asia Cement China Holdings Corp	105 930	0,05	900 500	HKD Sinopec Engineering Group Co Ltd	461 289	0,20
68 000	HKD China Aircraft Leasing Group Holdings Ltd	31 524	0,01	503 000	HKD Sunac Services Holdings Ltd	120 459	0,05
22 000	TWD Chlitina Holding Ltd	140 141	0,06	251 000	HKD Tianli International Holdings Ltd	103 826	0,04
235 000	HKD JNBY Design Ltd	316 000	0,14	466 000	HKD Tianneng Power International Ltd	393 279	0,17
241 000	HKD Nexteer Automotive Group Ltd	152 158	0,06	285 000	HKD Tong Ren Tang Technologies Co Ltd	239 065	0,10
1 221 500	HKD Shui On Land Ltd	112 630	0,05	5 098 000	HKD West China Cement Ltd	443 954	0,19
Îles Caïmans – Total				75 500			
858 383				0,37			
				China Holdings Co Ltd			
				23 785			
				0,01			

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)			
Chine (suite)				Inde			
124 600 HKD	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co Ltd	151 431	0,06	29 236 INR	360 ONE WAM LTD	249 396	0,11
349 000 HKD	Zhengzhou Coal Mining Machinery Group Co Ltd	382 586	0,16	23 416 INR	Aarti Drugs Ltd	137 659	0,06
Chine – Total				249 396			
8 726 888				3,73			
Égypte				172 165 INR			
24 134 EGP	Abou Kir Fertilizers & Chemical Industries	39 254	0,02	32 869 INR	Balrampur Chini Mills Ltd	162 126	0,07
27 810 EGP	Ezz Steel Co SAE	48 813	0,02	44 284 INR	Birlasoft Ltd	383 722	0,16
13 775 EGP	Misr Fertilizers Production Co SAE	147 037	0,06	169 304 INR	Castrol India Ltd	365 714	0,16
245 057 EGP	Telecom Egypt Co	175 363	0,07	13 790 INR	Ceat Ltd	402 197	0,17
Égypte – Total				102 826 INR			
410 467				0,17			
Grèce				43 892 INR			
24 090 EUR	Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	632 278	0,27	92 947 INR	Cochin Shipyard Ltd	1 512 317	0,65
14 246 EUR	Mytilineos SA	577 542	0,25	74 961 INR	Cyient Ltd	2 065 726	0,88
Grèce – Total				11 923 INR			
1 209 820				0,52			
Hong Kong				164 816 INR			
356 000 HKD	361 Degrees International Ltd	158 201	0,07	301 967 INR	Engineers India Ltd	622 160	0,27
58 000 HKD	China Foods Ltd	21 838	0,01	14 113 INR	Eris Lifesciences Ltd	154 335	0,07
567 000 HKD	China Overseas Grand Oceans Group Ltd	186 615	0,08	101 124 INR	Exide Industries Ltd	386 261	0,16
470 000 HKD	China Water Affairs Group Ltd	258 217	0,11	30 793 INR	Finolex Cables Ltd	395 636	0,17
130 000 HKD	CIMC Enric Holdings Ltd	117 538	0,05	49 235 INR	Finolex Industries Ltd	124 842	0,05
361 000 HKD	CITIC Telecom International Holdings Ltd	151 639	0,06	103 062 INR	Firstsource Solutions Ltd	228 941	0,10
5 740 000 HKD	Concord New Energy Group Ltd	470 459	0,20	222 421 INR	Fortis Healthcare Ltd	1 120 474	0,48
130 000 HKD	COSCO SHIPPING International Hong Kong Co Ltd	50 611	0,02	21 320 INR	GHCL Ltd	148 857	0,06
750 000 HKD	CSSC Hong Kong Shipping Co Ltd	142 152	0,06	15 371 INR	Glenmark Life Sciences Ltd	121 368	0,05
268 500 HKD	Genertec Universal Medical Group Co Ltd	154 390	0,07	170 032 INR	Glenmark Pharmaceuticals Ltd	1 744 890	0,74
119 500 HKD	Grand Pharmaceutical Group Ltd	62 592	0,03	12 594 INR	Godfrey Phillips India Ltd	319 164	0,14
97 000 HKD	HUTCHMED China Ltd	356 519	0,15	243 269 INR	Granules India Ltd	1 185 302	0,51
222 000 HKD	NetDragon Websoft Holdings Ltd	351 968	0,15	69 120 INR	Great Eastern Shipping Co Ltd	811 361	0,35
875 000 HKD	Poly Property Group Co Ltd	178 170	0,08	133 963 INR	Gujarat Narmada Valley Fertilizers & Chemicals Ltd	1 211 827	0,52
134 000 HKD	Shanghai Industrial Holdings Ltd	166 287	0,07	175 193 INR	Gujarat Pipavav Port Ltd	322 222	0,14
292 000 HKD	Shenzhen Investment Ltd	43 004	0,02	330 637 INR	Gujarat State Fertilizers & Chemicals Ltd	959 166	0,41
280 000 HKD	Shoucheng Holdings Ltd	56 297	0,02	348 595 INR	Gujarat State Petronet Ltd	1 281 880	0,55
1 559 162 HKD	Shougang Fushan Resources Group Ltd	575 060	0,25	32 135 INR	HeidelbergCement India Ltd	89 863	0,04
1 458 000 HKD	Sinofert Holdings Ltd	169 914	0,07	725 940 INR	Housing & Urban Development Corp Ltd	1 098 762	0,47
1 481 788 HKD	Skyworth Group Ltd	565 499	0,24	17 357 INR	ICICI Securities Ltd	149 763	0,06
128 000 HKD	SSY Group Ltd	80 978	0,03	527 950 INR	IDFC Ltd	803 531	0,34
1 152 000 HKD	Truly International Holdings Ltd	118 025	0,05	111 437 INR	Indo Count Industries Ltd	412 262	0,18
274 000 HKD	United Laboratories International Holdings Ltd	245 979	0,11	367 967 INR	IRB Infrastructure Developers Ltd	183 732	0,08
288 000 HKD	Wasion Holdings Ltd	144 580	0,06	281 038 INR	IRCON International Ltd	578 870	0,25
Hong-Kong – Total				30 818 INR			
4 826 532				0,20			
Hongrie				44 083 INR			
197 057 HUF	Magyar Telekom Telecommunications PLC	388 413	0,16	44 083 INR	JB Chemicals & Pharmaceuticals Ltd	860 668	0,37
Hongrie – Total				305 942 INR			
388 413				0,16			
				51 307 INR			
				223 124 INR			
				28 133 INR			
				48 696 INR			
				415 018			
				0,18			

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)				
Inde (suite)				Indonésie (suite)				
309 521	INR Karnataka Bank Ltd	870 570	0,37	787 500	IDR Bank Pembangunan Daerah Jawa Barat Dan Banten Tbk PT	58 818	0,03	
228 310	INR Karur Vysya Bank Ltd	463 404	0,20	2 928 300	IDR Bank Pembangunan Daerah Jawa Timur Tbk PT	118 867	0,05	
42 945	INR Kaveri Seed Co Ltd	316 151	0,13	1 167 200	IDR Indosat Tbk PT	710 690	0,30	
23 522	INR Laurus Labs Ltd	121 604	0,05	61 200	IDR Matahari Department Store Tbk PT	7 950	0,00	
38 499	INR LG Balakrishnan & Bros Ltd	582 132	0,25	2 560 000	IDR Medco Energi Internasional Tbk PT	192 037	0,08	
317 712	INR LIC Housing Finance Ltd	2 046 842	0,87	1 416 300	IDR Media Nusantara Citra Tbk PT	35 506	0,02	
160 971	INR LT Foods Ltd	393 076	0,17	2 307 900	IDR Mitra Adiperkasa Tbk PT	268 308	0,12	
6 680	INR Mahanagar Gas Ltd	96 370	0,04	6 652 900	IDR Panin Financial Tbk PT	114 072	0,05	
937 894	INR Manappuram Finance Ltd	1 938 595	0,83	2 562 900	IDR Perusahaan Gas Negara Tbk PT	188 094	0,08	
40 059	INR Motilal Oswal Financial Services Ltd	597 344	0,25	3 425 900	IDR Perusahaan Perkebunan London Sumatra Indonesia Tbk PT	198 029	0,08	
21 862	INR Narayana Hrudayalaya Ltd	315 777	0,13	9 845 700	IDR Puradelta Lestari Tbk PT	104 231	0,04	
20 474	INR Natco Pharma Ltd	199 625	0,08	628 700	IDR Sawit Sumbermas Sarana Tbk PT	42 670	0,02	
900 918	INR National Aluminium Co Ltd	1 428 564	0,61	Indonésie – Total			4 330 417	1,85
59 374	INR Nava Ltd	312 697	0,13	Corée				
535 739	INR NCC Ltd	1 073 554	0,46	19 921	KRW Aekyung Industrial Co Ltd	288 011	0,12	
339 112	INR Oil India Ltd	1 516 583	0,65	100 620	KRW BNK Financial Group Inc	557 828	0,24	
4 924	INR Oracle Financial Services Software Ltd	249 284	0,11	16 408	KRW Boryung	151 480	0,06	
27 516	INR Piramal Enterprises Ltd	307 983	0,13	12 028	KRW Chong Kun Dang Pharmaceutical Corp	1 222 506	0,52	
15 631	INR Polyplex Corp Ltd	197 487	0,08	7 175	KRW Classys Inc	210 308	0,09	
2 828	INR Procter & Gamble Health Ltd	168 148	0,07	3 908	KRW Com2uSCorp	149 444	0,06	
242 150	INR PTC India Ltd	553 041	0,24	5 987	KRW Cuckoo Holdings Co Ltd	76 145	0,03	
315 295	INR Rashtriya Chemicals & Fertilizers Ltd	604 342	0,26	8 063	KRW Daeduck Electronics Co Ltd / New	169 349	0,07	
12 822	INR Raymond Ltd	265 512	0,11	12 830	KRW Daewoong Co Ltd	205 714	0,09	
267 954	INR REC Ltd	1 329 405	0,57	2 489	KRW Daewoong Pharmaceutical Co Ltd	225 728	0,10	
372 802	INR Redington Ltd	792 073	0,34	34 960	KRW Daishin Securities Co Ltd	388 173	0,17	
56 501	INR RITES Ltd	341 123	0,14	13 634	KRW Daishin Securities Co Ltd–Preferred Stock	144 290	0,06	
350 283	INR Shipping Corp of India Ltd	685 717	0,29	9 099	KRW Daou Technology Inc	126 393	0,05	
242 949	INR Shipping Corp of India Ltd	78 975	0,03	28 936	KRW DB HiTek Co Ltd	1 316 600	0,56	
10 231	INR Sobha Ltd	121 190	0,05	8 469	KRW Dentium Co Ltd	861 433	0,37	
158 816	INR Sonata Software Ltd	1 417 561	0,60	86 897	KRW DGB Financial Group Inc	572 836	0,24	
49 371	INR Sun TV Network Ltd	422 551	0,18	4 446	KRW DN Automotive Corp	252 351	0,11	
12 396	INR Sundram Fasteners Ltd	186 043	0,08	2 531	KRW Dong-A ST Co Ltd	135 796	0,06	
20 688	INR Surya Roshni Ltd	193 185	0,08	4 952	KRW Dongkuk Holdings Co Ltd	33 759	0,01	
125 173	INR Tata Chemicals Ltd	1 660 825	0,71	15 427	KRW Dongkuk Steel Mill Co Ltd/New	144 220	0,06	
22 229	INR Tata Communications Ltd	472 903	0,20	50 149	KRW Dongwon Development Co Ltd	123 046	0,05	
230 661	INR Torrent Power Ltd	2 588 548	1,11	4 598	KRW Dongwon Industries Co Ltd	118 886	0,05	
66 793	INR Triveni Engineering & Industries Ltd	276 680	0,12	3 395	KRW Eugene Technology Co Ltd	107 552	0,05	
12 172	INR UTI Asset Management Co Ltd	126 761	0,05	23 784	KRW HAESUNG DS Co Ltd	1 023 087	0,44	
44 276	INR Vardhman Textiles Ltd	205 461	0,09	11 383	KRW Hansae Co Ltd	186 049	0,08	
75 086	INR Welspun Corp Ltd	494 610	0,21	9 706	KRW Hanwha Aerospace Co Ltd	938 269	0,40	
201 750	INR Welspun India Ltd	350 216	0,15	37 809	KRW Harim Holdings Co Ltd	228 105	0,10	
49 763	INR West Coast Paper Mills Ltd	436 192	0,19	19 568	KRW HD Hyundai Construction Equipment Co Ltd	785 516	0,34	
85 510	INR Zensar Technologies Ltd	627 501	0,27	108 729	KRW HD Hyundai Infracore Co Ltd	685 519	0,29	
Inde – Total			58 793 603	25,12	52 221	KRW HDC Hyundai Development Co-Engineering & Construction	591 992	0,25
Indonésie				7 181	KRW Huons Co Ltd	214 108	0,09	
17 380	100 IDR AKR Corporindo Tbk PT	1 664 977	0,71					
2 424	900 IDR Astra Otoparts Tbk PT	371 681	0,16					
2 311	700 IDR Bank CIMB Niaga Tbk PT	254 487	0,11					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)				
Corée (suite)				Koweït				
9 119	KRW Huons Global Co Ltd	167 454	0,07	71 268	KWD Boubyan Petrochemicals Co KSCP	135 693	0,06	
33 243	KRW Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	800 165	0,34	67 243	KWD Humansoft Holding Co KSC	743 886	0,32	
16 272	KRW Innox Advanced Materials Co Ltd	404 305	0,17	63 809	KWD Mezzan Holding Co KSCC	119 415	0,05	
7 230	KRW INTOPS Co Ltd	151 572	0,06	299 826	KWD National Investments Co KSCP	233 225	0,10	
251 601	KRW JB Financial Group Co Ltd	2 225 123	0,95	Koweït – Total			1 232 219	0,53
1 019	KRW KCC Corp	180 792	0,08	Malaisie				
3 653	KRW KCC Glass Corp	116 434	0,05	667 400	MYR Alliance Bank Malaysia Bhd	492 380	0,21	
66 333	KRW KG Chemical Corp	352 808	0,15	478 200	MYR Bermaz Auto Bhd	245 604	0,11	
10 410	KRW KG Eco Technology Service Co Ltd	91 095	0,04	8 795 600	MYR Bumi Armada Bhd	947 513	0,40	
3 078	KRW KIWOOM Securities Co Ltd	237 799	0,10	370 500	MYR IGBREIT	138 686	0,06	
3 427	KRW Kolon Industries Inc	118 411	0,05	1 080 800	MYR IJM Corp Bhd	442 199	0,19	
5 233	KRW KoMiCo Ltd	262 077	0,11	328 400	MYR Kossan Rubber Industries Bhd	132 218	0,06	
3 591	KRW Korea Electric Terminal Co Ltd	209 119	0,09	450 400	MYR KPJ Healthcare Bhd	141 148	0,06	
5 331	KRW Korea United Pharm Inc	111 761	0,05	302 100	MYR Matrix Concepts Holdings Bhd	108 480	0,05	
65 396	KRW Korean Reinsurance Co	363 057	0,16	188 600	MYR Scientex BHD	156 380	0,07	
24 261	KRW Kumho Tire Co Inc	101 535	0,04	243 719	MYR Sports Toto Bhd	78 499	0,03	
1 247	KRW Kyung Dong Navien Co Ltd	45 701	0,02	428 500	MYR SunwayREIT	143 611	0,06	
6 345	KRW LF Corp	65 376	0,03	209 100	MYR Ta Ann Holdings Bhd	166 552	0,07	
5 756	KRW LOTTE Fine Chemical Co Ltd	259 219	0,11	141 800	MYR TIME dotCom Bhd	166 642	0,07	
13 794	KRW LS Corp	998 215	0,43	627 800	MYR TSH Resources Bhd	133 211	0,06	
12 550	KRW LS Electric Co Ltd	713 301	0,30	44 600	MYR United Plantations BHD	172 770	0,07	
34 238	KRW LX International Corp	781 580	0,33	763 300	MYR YTL Power International Bhd	421 933	0,18	
8 582	KRW LX Semicon Co Ltd	578 397	0,25	Malaisie – Total			4 087 826	1,75
3 506	KRW Megastudyedu Co Ltd	165 241	0,07	Mexique				
1 884	KRW OCI Co Ltd/New	162 815	0,07	286 100	MXN Alsea SAB de CV	1 083 951	0,46	
7 326	KRW OCI Holdings Co Ltd	604 101	0,26	181 300	MXN Banco del Bajio SA	608 098	0,26	
11 498	KRW Orion Holdings Corp	130 345	0,06	113 600	MXN Concentradora Fibra Danhos SA de CV REIT	140 604	0,06	
64 761	KRW Partron Co Ltd	409 313	0,18	247 858	MXN Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV	986 924	0,42	
33 682	KRW PSK Inc	550 513	0,24	352 179	MXN FIBRA Macquarie Mexico REIT	691 485	0,30	
576	KRW Samyang Foods Co Ltd	96 604	0,04	172 400	MXN Genomma Lab Internacional SAB de CV	144 155	0,06	
11 085	KRW SeAH Besteel Holdings Corp	213 885	0,09	159 700	MXN Grupo Comercial Chedraui SA de CV	967 376	0,41	
1 838	KRW SeAH Steel Holdings Corp	342 511	0,15	121 900	MXN Regional SAB de CV	1 168 072	0,50	
35 199	KRW Sebang Co Ltd	334 252	0,14	193 367	MXN TF Administradora Industrial S de RL de CV REIT	412 551	0,18	
774	KRW Shinsegae Inc	105 291	0,05	Mexique – Total			6 203 216	2,65
6 643	KRW SIMMTECH Co Ltd	198 583	0,09	Philippines				
18 075	KRW SK D&D Co Ltd	414 017	0,18	1 839 000	PHP Alliance Global Group Inc	374 608	0,16	
1 096	KRW SK Gas Ltd	125 948	0,05	953 800	PHP First Gen Corp	299 704	0,13	
33 279	KRW SL Corp	922 479	0,39	227 400	PHP Manila Water Co Inc	76 382	0,03	
20 054	KRW SNT Motiv Co Ltd	672 671	0,29	324 600	PHP Robinsons Land Corp	93 438	0,04	
54 334	KRW Tongyang Life Insurance Co Ltd	191 112	0,08	215 240	PHP Robinsons Retail Holdings Inc	154 118	0,07	
2 440	KRW Unid Btplus Co Ltd	13 451	0,01	Philippines – Total			998 250	0,43
13 413	KRW Value Added Technology Co Ltd	346 286	0,15	Pologne				
287	KRW Young Poong Corp	114 987	0,05	8 799	PLN Asseco Poland SA	163 572	0,07	
31 968	KRW Youngone Corp	1 131 874	0,48	3 603	PLN Bank Handlowy w Warszawie SA	92 910	0,04	
11 023	KRW Youngone Holdings Co Ltd	667 594	0,29	2 302	PLN Budimex SA	366 470	0,16	
Corée – Total			12,60	6 352	PLN Kruk SA	770 527	0,33	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)			
Pologne (suite)				Taiwan (suite)			
558 836	PLN Orange Polska SA	1 156 825	0,49	210 000	TWD Chicony Electronics Co Ltd	1 197 439	0,51
30 252	PLN Warsaw Stock Exchange	326 965	0,14	144 000	TWD Chicony Power Technology Co Ltd	682 687	0,29
12 249	PLN XTB SA	117 810	0,05	255 000	TWD China Bills Finance Corp	125 462	0,05
Pologne – Total			1,28	699 000	TWD Chipbond Technology Corp	1 646 689	0,70
Qatar				851 000	TWD ChipMOS Technologies Inc	1 171 527	0,50
71 001	QAR Qatar Navigation QSC	187 204	0,08	84 000	TWD Chong Hong Construction Co Ltd	214 307	0,09
688 239	QAR Vodafone Qatar QSC	355 366	0,15	947 000	TWD Compeq Manufacturing Co Ltd	2 181 551	0,93
Qatar – Total			0,23	476 000	TWD Coretronic Corp	1 108 943	0,47
Russie				78 000	TWD Depo Auto Parts Ind Co Ltd	373 601	0,16
38 950	USD Globaltrans Investment PLC–GDR*	0	0,00	34 525	TWD Dimerco Express Corp	93 145	0,04
1 604	USD Ros Agro PLC–GDR*	0	0,00	162 800	TWD Elan Microelectronics Corp	861 993	0,37
24 863	USD Rostelecom PJSC–ADR*	0	0,00	608 000	TWD Everlight Electronics Co Ltd	990 535	0,42
37 981	USD Sistema PJSFC–GDR*	0	0,00	442 000	TWD Far Eastern Department Stores Ltd	356 446	0,15
Russie – Total			0,00	864 312	TWD Far Eastern International Bank	356 252	0,15
Arabie saoudite				188 000	TWD Farglory Land Development Co Ltd	347 938	0,15
128 659	SAR Abdullah Al Othaim Markets Co	449 449	0,19	80 000	TWD Feng Hsin Steel Co Ltd	180 121	0,08
78 172	SAR Al Hammadi Holding	1 244 498	0,53	12 000	TWD Fitipower Integrated Technology Inc	100 683	0,04
115 843	SAR Arriyadh Development Co	649 339	0,28	119 000	TWD Formosa Advanced Technologies Co Ltd	151 219	0,06
29 037	SAR Astra Industrial Group	1 023 651	0,44	18 000	TWD Fusheng Precision Co Ltd	121 112	0,05
19 762	SAR Middle East Healthcare Co	466 910	0,20	430 000	TWD Getac Holdings Corp	1 555 204	0,66
38 969	SAR National Medical Care Co	1 812 318	0,77	152 000	TWD Global Mixed Mode Technology Inc	1 307 506	0,56
2 347	SAR Saudia Dairy & Foodstuff Co	208 414	0,09	39 000	TWD Grape King Bio Ltd	198 237	0,08
97 316	SAR United International Transportation Co	2 042 338	0,87	166 275	TWD Great Wall Enterprise Co Ltd	316 941	0,14
Arabie saoudite – Total			3,37	98 000	TWD Greatek Electronics Inc	195 422	0,08
Afrique du Sud				375 000	TWD Hannstar Board Corp	675 698	0,29
65 775	ZAR AECL Ltd	394 524	0,17	213 000	TWD Huaku Development Co Ltd	668 347	0,29
141 571	ZAR Barloworld Ltd	611 571	0,26	81 000	TWD International Games System Co Ltd	1 910 819	0,82
46 688	ZAR DataTec Ltd	103 397	0,04	176 000	TWD ITE Technology Inc	863 068	0,37
152 858	ZAR Investec Ltd	1 049 757	0,45	814 600	TWD Kindom Development Co Ltd	1 031 173	0,44
481 178	ZAR KAP Ltd	68 937	0,03	892 000	TWD King Yuan Electronics Co Ltd	2 467 565	1,05
1 314 529	ZAR Momentum Metropolitan Holdings	1 573 481	0,67	515 000	TWD King's Town Bank Co Ltd	670 379	0,29
44 762	ZAR Oceana Group Ltd	172 978	0,07	28 000	TWD Kung Long Batteries Industrial Co Ltd	120 428	0,05
43 964	ZAR Omnia Holdings Ltd	157 153	0,07	31 557	TWD Lotes Co Ltd	1 100 210	0,47
67 581	ZAR Reunert Ltd	221 507	0,09	19 000	TWD Makalot Industrial Co Ltd	219 465	0,09
60 114	ZAR Sappi Ltd	145 293	0,06	156 000	TWD Merry Electronics Co Ltd	556 589	0,24
353 899	ZAR Super Group Ltd	575 721	0,25	35 314	TWD Pegavision Corp	456 232	0,20
565 075	ZAR Truworths International Ltd	2 297 379	0,98	25 000	TWD Phison Electronics Corp	423 584	0,18
548 584	ZAR Vukile Property Fund Ltd REIT	423 568	0,18	383 000	TWD Powertech Technology Inc	1 759 600	0,75
52 391	ZAR Zeda Ltd	36 527	0,02	512 702	TWD President Securities Corp	328 264	0,14
Afrique du Sud – Total			3,34	509 000	TWD Primax Electronics Ltd	1 122 800	0,48
Taiwan				135 000	TWD Prince Housing & Development Corp	48 826	0,02
101 000	TWD Acter Group Corp Ltd	584 138	0,25	171 000	TWD Qisda Corp	267 444	0,11
140 000	TWD Arcadyan Technology Corp	777 765	0,33	373 000	TWD Radiant Opto-Electronics Corp	1 616 429	0,69
602 000	TWD Ardentec Corp	1 451 524	0,62	12 000	TWD Raydium Semiconductor Corp	156 596	0,07
127 399	TWD Asia Vital Components Co Ltd	1 396 842	0,60	338 000	TWD Sanyang Motor Co Ltd	786 341	0,34
36 000	TWD Aten International Co Ltd	94 192	0,04	207 000	TWD Sercomm Corp	907 170	0,39
1 247 861	TWD Capital Securities Corp	664 783	0,28				
122 000	TWD Cheng Uei Precision Industry Co Ltd	192 001	0,08				
76 000	TWD Chia Chang Co Ltd	107 721	0,05				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 93,41 % (suite)					
Taïwan (suite)				Turquie					
120 000	TWD Shinkong Insurance Co Ltd	266 271	0,11	28 090	TRY Aksa Akrikil Kimya Sanayii AS	97 964	0,04		
163 000	TWD Shinkong Synthetic Fibers Corp	82 587	0,04	195 944	TRY Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	912 247	0,39		
60 508	TWD Sigurd Microelectronics Corp	128 545	0,06	43 058	TRY Coca-Cola Icecek AS	766 133	0,33		
102 000	TWD Simplo Technology Co Ltd	1 395 872	0,60	217 735	TRY Dogan Sirketler Grubu Holding AS	81 538	0,03		
198 000	TWD Sino-American Silicon Products Inc	1 264 496	0,54	99 745	TRY Dogus Otomotiv Servis ve Ticaret AS	867 964	0,37		
111 000	TWD Sinon Corp	139 064	0,06	341 643	TRY Enerjisa Enerji AS	526 797	0,23		
118 000	TWD Sitronix Technology Corp	1 068 865	0,46	114 170	TRY Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret AS	450 356	0,19		
73 000	TWD TaiDoc Technology Corp	392 467	0,17	44 394	TRY Migros Ticaret AS	503 555	0,22		
194 000	TWD Taiwan Hon Chuan Enterprise Co Ltd	790 147	0,34	156 563	TRY Sok Marketler Ticaret AS	285 995	0,12		
1 041 000	TWD Teco Electric and Machinery Co Ltd	1 587 423	0,68	48 373	TRY Turk Traktor ve Ziraat Makineleri AS	1 166 167	0,50		
83 000	TWD Test Research Inc	169 567	0,07	Turquie – Total			5 658 716	2,42	
334 000	TWD Ton Yi Industrial Corp	175 758	0,08	Émirats arabes unis					
356 000	TWD Tong Yang Industry Co Ltd	881 576	0,38	1 526 172	AED Air Arabia PJSC	1 171 821	0,50		
20 000	TWD Topkey Corp	116 649	0,05	114 267	AED National Central Cooling Co PJSC	111 381	0,05		
44 000	TWD Tripod Technology Corp	279 565	0,12	Émirats arabes unis – Total			1 283 202	0,55	
275 000	TWD TSRC Corp	215 946	0,09	Total des actions ordinaires et préférentielles				218 613 940	93,41
88 000	TWD TTY Biopharm Co Ltd	230 534	0,10	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				229 956 568	98,26
99 000	TWD TXC Corp	318 059	0,14	Autres valeurs mobilières					
152 239	TWD United Integrated Services Co Ltd	1 312 042	0,56	Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 %					
507 000	TWD USI Corp	326 265	0,14	Russie					
350 672	TWD Wisdom Marine Lines Co Ltd	594 156	0,25	7 404	USD PhosAgro PJSC–GDR*	0	0,00		
105 000	TWD Wistron Corp	337 336	0,14	48	USD PHOSAGRO PJSC*	0	0,00		
229 000	TWD YFY Inc	243 248	0,10	25 422	RUB Rostelecom PJSC*	0	0,00		
51 000	TWD Yungshin Construction & Development Co Ltd	153 380	0,07	11 839 000	RUB Unipro PJSC*	0	0,00		
25 000	TWD Zippy Technology Corp	39 955	0,02	Russie – Total			0	0,00	
Taiwan – Total				Total des actions ordinaires et préférentielles				0	0,00
Taïlande				Total des autres valeurs mobilières				0	0,00
2 490 700	THB AP Thailand PCL	824 578	0,35	TOTAL DES INVESTISSEMENTS				229 956 568	98,26
653 200	THB Bangkok Chain Hospital PCL	428 673	0,18	Autres actifs/(passifs) nets				4 083 008	1,74
3 825 500	THB Chularat Hospital PCL	351 925	0,15	TOTAL DES ACTIFS NETS				234 039 576	100,00
1 859 800	THB Ichitan Group PCL	855 456	0,37	* Le Conseil d'administration a décidé de fixer le prix du titre à 0,00 conformément aux procédures d'évaluation des investissements en vigueur.					
192 100	THB Kiatnakin Phatra Bank PCL	282 810	0,12						
24 600	THB Kiatnakin Phatra Bank PCL–NVDR	36 216	0,02						
51 700	THB Mega Lifesciences PCL	60 966	0,03						
1 140 300	THB Origin Property PCL	282 298	0,12						
225 400	THB Precious Shipping PCL	57 122	0,02						
131 200	THB Prukha Holding PCL	46 511	0,02						
349 300	THB Regional Container Lines PCL	247 654	0,11						
6 704 600	THB Sansiri PCL	347 679	0,15						
447 900	THB SPCG PCL	162 718	0,07						
603 900	THB Supalai PCL	329 086	0,14						
503 000	THB Thaicom PCL	194 524	0,08						
162 400	THB Thanachart Capital PCL	235 518	0,10						
210 659	THB Tisco Financial Group PCL	615 637	0,26						
Taïlande – Total									
		5 359 371	2,29						

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,55 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,55 % <i>(suite)</i>			
Australie				Hong Kong <i>(suite)</i>			
23 299 AUD	Brambles Ltd	216 214	0,08	1 205 170 HKD	HKT Trust & HKT Ltd	1 438 447	0,52
47 731 AUD	Coles Group Ltd	524 690	0,19	1 500 134 HKD	Hong Kong & China Gas Co Ltd	1 148 843	0,41
16 930 AUD	Woolworths Group Ltd	429 741	0,15	37 900 USD	Hongkong Land Holdings Ltd	131 892	0,05
Australie – Total		1 170 645	0,42	15 000 USD	Jardine Matheson Holdings Ltd	618 150	0,22
Belgique				105 560 HKD	Link REIT	592 787	0,21
1 491 EUR	Ucb SA	129 951	0,05	180 607 HKD	MTR Corp Ltd	700 821	0,25
Belgique – Total		129 951	0,05	152 000 HKD	Power Assets Holdings Ltd	880 829	0,32
Bermudes				143 000 HKD	SITC International Holdings Co Ltd	246 863	0,09
3 100 USD	Arch Capital Group Ltd	230 237	0,08	165 000 HKD	Sun Hung Kai Properties Ltd	1 784 486	0,64
Bermudes – Total		230 237	0,08	480 000 HKD	WH Group Ltd	309 814	0,11
Canada				Hong-Kong – Total		10 994 679	3,95
53 703 CAD	BCE Inc	2 124 743	0,76	Israël			
54 178 CAD	CCL Industries Inc	2 448 405	0,88	24 106 ILS	Bank Hapoalim BM	217 636	0,08
34 902 CAD	Dollarama Inc	2 527 523	0,91	132 084 ILS	Bank Leumi Le-Israel BM	1 067 779	0,39
8 690 CAD	Empire Co Ltd	230 991	0,08	8 800 USD	Check Point Software Technologies Ltd	1 344 552	0,48
13 582 CAD	Fortis Inc	561 470	0,20	1 ILS	Isracard Ltd	3	0,00
7 300 CAD	George Weston Ltd	910 701	0,33	Israël – Total		2 629 970	0,95
6 900 CAD	Hydro One Ltd	207 743	0,07	Italie			
3 590 CAD	Loblaw Cos Ltd	349 253	0,13	54 783 EUR	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	692 909	0,25
51 934 CAD	Metro Inc/CN REIT	2 701 466	0,97	33 753 EUR	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	1 820 639	0,65
115 367 CAD	Telus Corp	2 063 062	0,74	Italie – Total		2 513 548	0,90
991 CAD	Telus Corp	17 722	0,01	Japon			
Canada – Total		14 143 079	5,08	67 200 JPY	Aeon Co Ltd	1 501 966	0,54
Finlande				21 100 JPY	Chubu Electric Power Co Inc	272 618	0,10
43 495 EUR	Elisa OYJ	2 011 718	0,72	8 000 JPY	East Japan Railway Co	461 285	0,16
9 495 EUR	Orion Oyj	411 889	0,15	160 800 JPY	Japan Post Holdings Co Ltd	1 436 570	0,52
11 934 EUR	Sampo Oyj	522 175	0,19	67 700 JPY	Japan Tobacco Inc	1 750 365	0,63
Finlande – Total		2 945 782	1,06	87 300 JPY	KDDI Corp	2 777 896	1,00
France				15 052 JPY	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	652 346	0,23
97 849 EUR	Orange SA	1 113 748	0,40	9 700 JPY	MEIJI Holdings Co Ltd	230 425	0,08
3 130 EUR	Sanofi SA	310 350	0,11	1 396 700 JPY	Nippon Telegraph & Telephone Corp	1 706 990	0,61
5 985 EUR	Vivendi SE	63 972	0,03	87 303 JPY	Nissin Foods Holdings Co Ltd	3 047 369	1,09
France – Total		1 488 070	0,54	1 300 JPY	Oracle Corp Japan	100 234	0,04
Allemagne				9 700 JPY	Osaka Gas Co Ltd	202 628	0,07
31 844 EUR	Deutsche Telekom AG	765 088	0,27	44 590 JPY	SG Holdings Co Ltd	640 163	0,23
794 EUR	Hannover Rueck SE	189 715	0,07	265 150 JPY	Softbank Corp	3 309 203	1,19
5 702 EUR	Henkel AG & Co KGaA	409 291	0,15	83 900 JPY	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	2 412 616	0,87
4 811 EUR	Henkel AG & Co KGaA–Preferred Stock	387 212	0,14	10 100 JPY	Tobu Railway Co Ltd	271 449	0,10
2 339 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	969 175	0,35	46 850 JPY	Toho Co Ltd	1 584 818	0,57
Allemagne – Total		2 720 481	0,98	17 100 JPY	Tokyo Gas Co Ltd	392 749	0,14
Hong Kong				33 300 JPY	Unicharm Corp	1 204 167	0,43
358 000 HKD	BOC Hong Kong Holdings Ltd	971 960	0,35	34 046 JPY	USS Co Ltd	684 880	0,25
60 500 HKD	CK Hutchison Holdings Ltd	324 250	0,12	Japon – Total		24 640 737	8,85
69 500 HKD	CK Infrastructure Holdings Ltd	384 502	0,14	Pays-Bas			
243 200 HKD	ESR Group Ltd	336 370	0,12	316 570 EUR	Koninklijke KPN NV	1 090 362	0,39
88 000 HKD	Hang Seng Bank Ltd	1 026 106	0,37	Pays-Bas – Total		1 090 362	0,39
32 000 HKD	Henderson Land Development Co Ltd	98 559	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,55 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,55 % (suite)			
Nouvelle-Zélande				États-Unis (suite)			
830 921	NZD Spark New Zealand Ltd	2 725 185	0,98	25 418	USD CH Robinson Worldwide Inc	2 195 861	0,79
Nouvelle-Zélande – Total				12 400	USD Cheniere Energy Inc	2 116 804	0,76
		2 725 185	0,98	32 933	USD Church & Dwight Co Inc	3 114 144	1,12
Norvège				10 700	USD Cigna Group	3 204 115	1,15
34 777	NOK Orkla ASA	269 978	0,10	55 300	USD Cisco Systems Inc	2 793 756	1,00
Norvège – Total				13 770	USD Clorox Co	1 963 464	0,71
		269 978	0,10	46 998	USD Coca-Cola Co	2 769 592	0,99
Portugal				38 799	USD Colgate-Palmolive Co	3 092 668	1,11
6 565	EUR Jeronimo Martins SGPS SA	167 087	0,06	16 700	USD Comcast Corp	732 295	0,26
Portugal – Total				5 800	USD Conagra Brands Inc	166 228	0,06
		167 087	0,06	31 821	USD Consolidated Edison Inc	2 894 756	1,04
Singapour				10 267	USD Dollar General Corp	1 395 799	0,50
190,80	SGD Genting Singapore Ltd	144 644	0,05	1 600	USD Dollar Tree Inc	227 280	0,08
338 330	SGD Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	3 334 311	1,20	43 300	USD Edison International	3 095 517	1,11
346 483	SGD Singapore Exchange Ltd	2 582 009	0,93	20 621	USD Electronic Arts Inc	2 821 159	1,01
160 900	SGD Singapore Technologies Engineering Ltd	474 491	0,17	4 735	USD Eli Lilly & Co	2 760 126	0,99
1 297 175	SGD Singapore Telecommunications Ltd	2 428 946	0,87	23 200	USD Entergy Corp	2 347 608	0,84
34 700	SGD United Overseas Bank Ltd	748 400	0,27	2 900	USD Erie Indemnity Co	971 268	0,35
Singapour – Total				7 510	USD Eversource Energy	463 517	0,17
		9 712 801	3,49	64 000	USD Exelon Corp	2 297 600	0,83
Suisse				15 166	USD Expeditors International of Washington Inc	1 929 115	0,69
481	CHF Barry Callebaut AG	810 953	0,29	41 702	USD General Mills Inc	2 716 468	0,98
243	CHF Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	2 913 171	1,05	35 021	USD Gilead Sciences Inc	2 837 051	1,02
10 715	CHF Nestle SA	1 241 394	0,44	9 000	USD Globe Life Inc	1 095 480	0,39
26 672	CHF Novartis AG	2 689 542	0,97	11 124	USD Hershey Co	2 073 959	0,74
7 540	CHF Roche Holding AG	2 190 376	0,79	64 439	USD Hormel Foods Corp	2 069 136	0,74
18 311	CHF Swiss Prime Site AG	1 954 783	0,70	3 500	USD Humana Inc	1 602 335	0,58
4 732	CHF Swisscom AG	2 844 878	1,02	1 000	USD Illinois Tool Works Inc	261 940	0,09
1 765	CHF Zurich Insurance Group AG	921 873	0,33	24 300	USD Incyte Corp	1 525 797	0,55
Suisse – Total				4 400	USD International Business Machines Corp	719 620	0,26
		15 566 970	5,59	14 800	USD International Paper Co	535 020	0,19
Royaume-Uni				12 952	USD J M Smucker Co	1 636 874	0,59
59 674	GBP GSK PLC	1 103 202	0,40	16 806	USD Johnson & Johnson	2 634 172	0,95
8 497	GBP Imperial Brands PLC	195 679	0,07	33 003	USD Kellanova	1 845 198	0,66
23 595	GBP Pearson PLC	290 021	0,10	10 097	USD Kenvue Inc	217 388	0,08
22 298	GBP Reckitt Benckiser Group PLC	1 540 661	0,55	24 100	USD Keurig Dr Pepper Inc	803 012	0,29
Royaume-Uni – Total				23 825	USD Kimberly-Clark Corp	2 894 976	1,04
		3 129 563	1,12	155 500	USD Kinder Morgan Inc	2 743 020	0,99
États-Unis				64 900	USD Kraft Heinz Co	2 400 002	0,86
18 800	USD AbbVie Inc	2 913 436	1,05	63 800	USD Kroger Co	2 916 298	1,05
65 996	USD Altria Group Inc	2 662 279	0,96	18 100	USD Loews Corp	1 259 579	0,45
11 655	USD Amgen Inc	3 356 873	1,21	31 936	USD McCormick & Co Inc	2 185 061	0,78
11 585	USD Arthur J Gallagher & Co	2 605 235	0,94	10 800	USD McDonald's Corp	3 202 308	1,15
155 500	USD AT&T Inc	2 609 290	0,94	6 300	USD McKesson Corp	2 916 774	1,05
21 244	USD Atmos Energy Corp	2 462 180	0,88	26 561	USD Merck & Co Inc	2 895 680	1,04
11 750	USD Becton Dickinson and Co	2 865 003	1,03	2 600	USD Molina Healthcare Inc	939 406	0,34
10 300	USD Biogen Inc	2 665 331	0,96	34 400	USD Mondelez International Inc	2 491 592	0,90
20 400	USD BioMarin Pharmaceutical Inc	1 966 968	0,71	10 600	USD Neurocrine Biosciences Inc	1 396 656	0,50
40 600	USD Bristol-Myers Squibb Co	2 083 186	0,75	700	USD O'Reilly Automotive Inc	665 056	0,24
23 900	USD Campbell Soup Co	1 033 197	0,37	18 815	USD PepsiCo Inc	3 195 540	1,15
28 200	USD Cardinal Health Inc	2 842 560	1,02	36 057	USD Pfizer Inc	1 038 081	0,37
9 900	USD Cboe Global Markets Inc	1 767 744	0,63				
13 800	USD Cencora Inc	2 834 244	1,02				
71 500	USD CenterPoint Energy Inc	2 042 755	0,73				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 99,55 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,55 % (suite)				
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)				
15 400	USD Philip Morris International Inc	1 448 832	0,52	3 300	USD United Therapeutics Corp	725 637	0,26	
18 825	USD Procter & Gamble Co	2 758 616	0,99	5 000	USD UnitedHealth Group Inc	2 632 350	0,95	
2 100	USD Progressive Corp	334 488	0,12	61 496	USD Verizon Communications Inc	2 318 399	0,83	
45 600	USD Public Service Enterprise Group Inc	2 788 440	1,00	9 000	USD Vertex Pharmaceuticals Inc	3 662 010	1,32	
13 582	USD Quest Diagnostics Inc	1 872 686	0,67	14 600	USD W R Berkley Corp	1 032 512	0,37	
3 375	USD Regeneron Pharmaceuticals Inc	2 964 229	1,06	17 082	USD Waste Management Inc	3 059 386	1,10	
19 402	USD Republic Services Inc	3 199 584	1,15	89 200	USD Williams Cos Inc	3 106 836	1,12	
47 150	USD Rollins Inc	2 059 041	0,74	États-Unis – Total			180 819 057	64,96
5 000	USD Roper Technologies Inc	2 725 850	0,98	Total des actions ordinaires et préférentielles			277 088 182	99,55
40 500	USD Royalty Pharma PLC	1 137 645	0,41	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			277 088 182	99,55
32 600	USD Sempra	2 436 198	0,88	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			277 088 182	99,55
17 100	USD T-Mobile US Inc	2 741 643	0,98					
10 700	USD Travelers Cos Inc	2 038 243	0,73					

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – 0,08 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold HKD, due 30/01/24	JPMorgan Chase Bank NA	4 590 653	39 452 633	20 847	0,01
Bought EUR / Sold ILS, due 31/01/24	JPMorgan Chase Bank NA	1 090 073	4 333 864	1 278	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 30/01/24	BNP Paribas SA	26 208 046	28 852 438	128 777	0,05
Bought EUR / Sold USD, due 30/01/24	HSBC BANKUSA	26 224 364	28 852 438	146 820	0,05
Bought EUR / Sold USD, due 30/01/24	Royal Bank of Canada	26 195 554	28 852 438	114 963	0,04
Bought JPY / Sold EUR, due 30/01/24	Morgan Stanley And Co LLC	61 746 000	397 023	664	0,00
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				413 349	0,15

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold AUD, due 30/01/24	JPMorgan Chase Bank NA	404 066	654 978	(493)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 30/01/24	JPMorgan Chase Bank NA	6 060 275	8 891 653	(44 440)	(0,02)
Bought EUR / Sold CHF, due 30/01/24	Toronto Dominion Bank	6 818 626	6 408 533	(94 699)	(0,04)
Bought EUR / Sold GBP, due 30/01/24	Toronto Dominion Bank	1 361 503	1 181 353	(642)	(0,00)
Bought EUR / Sold JPY, due 30/01/24	Toronto Dominion Bank	10 872 008	1 691 999 664	(26 426)	(0,01)
Bought EUR / Sold NOK, due 30/01/24	JPMorgan Chase Bank NA	26 986	305 382	(248)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 30/01/24	JPMorgan Chase Bank NA	1 189 037	2 082 062	(3 539)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 30/01/24	JPMorgan Chase Bank NA	4 104 986	5 988 795	(6 259)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 30/01/24	Royal Bank of Canada	1 654 000	1 503 003	(8 041)	(0,00)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(184 787)	(0,07)
Total des contrats de change à terme – couverture				228 562	0,08

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats à terme standardisés – 0,01 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
MSCI EAFE INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	3	337 860	9 625	0,00
S&P EMINI INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	3	723 000	17 095	0,01
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			1 060 860	26 720	0,01
Total des contrats à terme standardisés			1 060 860	26 720	0,01
Autres actifs/(passifs) nets				998 604	0,36
TOTAL DES ACTIFS NETS				278 342 068	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 16 873 USD détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 %				Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % <i>(suite)</i>			
Australie				Jersey			
12 151	AUD BHP Group Ltd	417 961	0,39	7 855	USD Ferguson PLC	1 516 565	1,40
107 350	AUD Brambles Ltd	996 203	0,92	Jersey – Total			
19 345	AUD Fortescue Ltd	383 066	0,35	1 516 565 1,40			
Australie – Total				Pays-Bas			
1 797 230 1,66				43 485	EUR Koninklijke Ahold Delhaize NV	1 249 649	1,15
Bermudes				390 086	EUR Koninklijke KPN NV	1 343 573	1,24
1 630	USD Everest Group Ltd	576 335	0,53	Pays-Bas – Total			
Bermudes – Total				2 593 222 2,39			
Canada				Nouvelle-Zélande			
14 117	CAD Empire Co Ltd	375 247	0,35	97 479	NZD Spark New Zealand Ltd	319 704	0,30
15 562	CAD Loblaw Cos Ltd	1 513 949	1,39	Nouvelle-Zélande – Total			
12 911	CAD Metro Inc/CN REIT	671 596	0,62	319 704 0,30			
Canada – Total				Singapour			
2 560 792 2,36				15 995	SGD DBS Group Holdings Ltd	405 119	0,37
Finlande				113 804	SGD Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	1 121 562	1,03
102 191	EUR Nordea Bank Abp	1 267 251	1,17	26 500	SGD United Overseas Bank Ltd	571 545	0,53
Finlande – Total				Singapour – Total			
1 267 251 1,17				2 098 226 1,93			
France				Suisse			
10 472	EUR Sanofi SA	1 038 334	0,96	9 934	CHF Holcim AG	779 235	0,72
France – Total				13 955	CHF Novartis AG	1 407 189	1,30
1 038 334 0,96				Suisse – Total			
Allemagne				2 186 424 2,02			
25 333	EUR Deutsche Telekom AG	608 654	0,56	Royaume-Uni			
Allemagne – Total				156 285	GBP Centrica PLC	280 220	0,26
608 654 0,56				36 813	GBP GSK PLC	680 567	0,63
Hong Kong				156 340	GBP J Sainsbury PLC	603 089	0,55
116 500	HKD CK Asset Holdings Ltd	584 846	0,54	7 844	AUD Rio Tinto Ltd	726 100	0,67
183 000	HKD CK Hutchison Holdings Ltd	980 790	0,90	389 882	GBP Tesco PLC	1 443 847	1,33
Hong-Kong – Total				Royaume-Uni – Total			
1 565 636 1,44				3 733 823 3,44			
Israël				États-Unis			
4 400	USD Check Point Software Technologies Ltd	672 276	0,62	8 875	USD AbbVie Inc	1 375 359	1,27
Israël – Total				4 230	USD Alphabet Inc	596 134	0,55
672 276 0,62				19 058	USD American International Group Inc	1 291 180	1,19
Italie				3 812	USD Amgen Inc	1 097 932	1,01
27 240	EUR UniCredit SpA	739 177	0,68	15 567	USD Archer-Daniels-Midland Co	1 124 249	1,04
Italie – Total				504	USD AutoZone Inc	1 303 147	1,20
739 177 0,68				12 366	USD Bristol-Myers Squibb Co	634 499	0,58
Japon				602	USD Broadcom Inc	671 983	0,62
55 700	JPY Canon Inc	1 430 231	1,32	12 242	USD Bunge Global SA	1 235 830	1,14
56 900	JPY Chubu Electric Power Co Inc	735 164	0,68	19 258	USD Campbell Soup Co	832 523	0,77
31 000	JPY Daiwa House Industry Co Ltd	939 367	0,87	14 023	USD Cardinal Health Inc	1 413 518	1,30
46 500	JPY Honda Motor Co Ltd	483 537	0,44	7 547	USD Cboe Global Markets Inc	1 347 592	1,24
37 800	JPY Itochu Corp	1 546 266	1,42	6 302	USD Cencora Inc	1 294 305	1,19
12 800	JPY Kajima Corp	213 954	0,20	7 049	USD Centene Corp	523 106	0,48
83 400	JPY Marubeni Corp	1 318 321	1,21	3 796	USD Cigna Group	1 136 712	1,05
102 300	JPY Mitsubishi Corp	1 635 218	1,51	28 541	USD Cisco Systems Inc	1 441 891	1,33
33 300	JPY Mitsui & Co Ltd	1 251 407	1,15	6 202	USD CME Group Inc	1 306 141	1,20
19 900	JPY NEC Corp	1 178 642	1,09	30 815	USD Comcast Corp	1 351 238	1,25
9 200	JPY Nomura Real Estate Holdings Inc	242 040	0,22	31 271	USD Conagra Brands Inc	896 227	0,83
33 000	JPY Renesas Electronics Corp	596 659	0,55	14 814	USD Consolidated Edison Inc	1 347 630	1,24
28 200	JPY Sekisui House Ltd	626 489	0,58	14 209	USD CVS Health Corp	1 121 943	1,03
17 100	JPY Subaru Corp	313 666	0,29	1 382	USD Darden Restaurants Inc	227 063	0,21
58 500	JPY Tokyo Gas Co Ltd	1 343 616	1,24	12 624	USD Dell Technologies Inc	965 736	0,89
Japon – Total				19 432	USD Dropbox Inc	572 855	0,53
13 854 577 12,77							

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 99,33 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
10 394	USD Electronic Arts Inc	1 422 003	1,31	36 100	USD Verizon Communications Inc	1 360 970	1,25
1 544	USD Elevance Health Inc	728 089	0,67	8 905	USD Waste Management Inc	1 594 886	1,47
2 544	USD Eli Lilly & Co	1 482 948	1,37	États-Unis – Total			
4 414	USD Exxon Mobil Corp	441 312	0,41			70 609 357	65,10
4 230	USD FedEx Corp	1 070 063	0,99	Total des actions ordinaires et préférentielles			
8 084	USD General Mills Inc	526 592	0,49			107 737 583	99,33
16 846	USD Gilead Sciences Inc	1 364 694	1,26	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
7 055	USD GoDaddy Inc	748 959	0,69			107 737 583	99,33
3 811	USD Hershey Co	710 523	0,65	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
81 895	USD Hewlett Packard Enterprise Co	1 390 577	1,28			107 737 583	99,33
29 517	USD HP Inc	888 167	0,82	Autres actifs/(passifs) nets			
2 292	USD Humana Inc	1 049 301	0,97			724 598	0,67
3 267	USD International Business Machines Corp	534 318	0,49	TOTAL DES ACTIFS NETS			
5 888	USD Johnson & Johnson	922 885	0,85			108 462 181	100,00
30 027	USD Juniper Networks Inc	885 196	0,82				
5 057	USD Kimberly-Clark Corp	614 476	0,57				
26 065	USD Kroger Co	1 191 431	1,10				
6 134	USD Marathon Petroleum Corp	910 040	0,84				
3 655	USD McDonald's Corp	1 083 744	1,00				
2 931	USD McKesson Corp	1 356 994	1,25				
12 883	USD Merck & Co Inc	1 404 505	1,29				
3 593	USD Microsoft Corp	1 351 112	1,25				
10 157	USD Mondelez International Inc	735 672	0,68				
16 348	USD NetApp Inc	1 441 240	1,33				
10 779	USD NRG Energy Inc	557 274	0,51				
142	USD NVR Inc	994 064	0,92				
6 357	USD Omnicom Group Inc	549 944	0,51				
11 531	USD Oracle Corp	1 215 713	1,12				
14 399	USD Paccar Inc	1 406 062	1,30				
14 960	USD Pfizer Inc	430 698	0,40				
7 565	USD Phillips 66	1 007 204	0,93				
9 397	USD Procter & Gamble Co	1 377 036	1,27				
6 319	USD Prudential Financial Inc	655 344	0,60				
9 089	USD Quest Diagnostics Inc	1 253 191	1,15				
686	USD Regeneron Pharmaceuticals Inc	602 507	0,56				
1 009	USD Reliance Steel & Aluminum Co	282 197	0,26				
11 736	USD Republic Services Inc	1 935 384	1,78				
7 433	USD Sempra	555 468	0,51				
2 510	USD Snap-on Inc	724 988	0,67				
12 311	USD TJX Cos Inc	1 154 895	1,06				
5 759	USD T-Mobile US Inc	923 340	0,85				
1 626	USD United Parcel Service Inc	255 656	0,24				
2 532	USD UnitedHealth Group Inc	1 333 022	1,23				
8 276	USD Valero Energy Corp	1 075 880	0,99				

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)				
Obligations d'État – 98,47 %				Obligations d'État – 98,47 % (<i>suite</i>)				
Australie				Autriche (<i>suite</i>)				
6 370 000 AUD	Australia Government Bond, 3.250%, 21/04/25	4 313 100	0,09	3 178 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.500%, 20/02/29	3 206 281	0,07	
5 800 000 AUD	Australia Government Bond, 0.250%, 21/11/25	3 710 950	0,08	850 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.900%, 23/05/29	967 966	0,02	
7 204 000 AUD	Australia Government Bond, 4.250%, 21/04/26	4 980 633	0,10	2 450 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/02/30	2 343 330	0,05	
7 400 000 AUD	Australia Government Bond, 0.500%, 21/09/26	4 646 902	0,10	500 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 3.450%, 20/10/30	586 691	0,01	
5 845 000 AUD	Australia Government Bond, 4.750%, 21/04/27	4 129 202	0,09	2 600 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/02/31	2 416 203	0,05	
7 933 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/11/27	5 245 654	0,11	2 600 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.900%, 20/02/32	2 527 727	0,05	
6 359 000 AUD	Australia Government Bond, 2.250%, 21/05/28	4 100 284	0,09	2 550 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.900%, 20/02/33	2 889 476	0,06	
5 491 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/11/28	3 599 122	0,07	Autriche – Total			35 326 082	0,74
7 355 000 AUD	Australia Government Bond, 3.250%, 21/04/29	4 916 603	0,10	Belgique				
7 900 000 AUD	Australia Government Bond, 2.750%, 21/11/29	5 116 830	0,11	4 200 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/25	4 515 701	0,09	
6 700 000 AUD	Australia Government Bond, 2.500%, 21/05/30	4 248 156	0,09	2 452 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.500%, 28/03/26	2 831 491	0,06	
6 150 000 AUD	Australia Government Bond, 1.000%, 21/12/30	3 482 383	0,07	3 716 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.000%, 22/06/26	3 974 263	0,08	
7 200 000 AUD	Australia Government Bond, 1.500%, 21/06/31	4 173 279	0,09	3 587 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/27	3 774 365	0,08	
6 900 000 AUD	Australia Government Bond, 1.000%, 21/11/31	3 797 268	0,08	2 100 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.010%, 22/10/27	2 134 346	0,05	
7 500 000 AUD	Australia Government Bond, 1.250%, 21/05/32	4 155 868	0,09	2 748 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 5.500%, 28/03/28	3 433 391	0,07	
5 500 000 AUD	Australia Government Bond, 1.750%, 21/11/32	3 144 049	0,07	3 441 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.800%, 22/06/28	3 575 278	0,08	
4 800 000 AUD	Australia Government Bond, 4.500%, 21/04/33	3 416 509	0,07	4 003 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.900%, 22/06/29	4 111 850	0,09	
5 500 000 AUD	Australia Government Bond, 3.000%, 21/11/33	3 461 397	0,07	2 650 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.100%, 22/06/30	2 538 604	0,05	
Australie – Total			74 638 189	1,57	3 450 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.000%, 22/06/31	3 442 858	0,07
Autriche				2 350 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.010%, 22/10/31	2 147 222	0,05	
2 000 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/04/25	2 133 278	0,05	2 300 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 4.000%, 28/03/32	2 824 796	0,06	
3 449 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 1.200%, 20/10/25	3 728 025	0,08	3 000 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 0.350%, 22/06/32	2 770 330	0,06	
2 317 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 4.850%, 15/03/26	2 691 006	0,06	2 450 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 1.250%, 22/04/33	2 422 682	0,05	
550 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 2.000%, 15/07/26	602 588	0,01	3 500 000 EUR	Kingdom of Belgium Government Bond, 3.000%, 22/06/33	3 992 432	0,08	
2 301 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/10/26	2 433 748	0,05	Belgique – Total			48 489 609	1,02
2 859 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.500%, 20/04/27	2 981 494	0,06	Canada				
691 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 6.250%, 15/07/27	864 628	0,02	1 900 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.750%, 01/02/25	1 430 490	0,03	
2 769 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.750%, 20/02/28	2 874 760	0,06	3 200 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.250%, 01/03/25	2 343 819	0,05	
2 100 000 EUR	Republic of Austria Government Bond, 0.010%, 20/10/28	2 078 881	0,04	1 750 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/04/25	1 282 652	0,03	
				2 500 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.750%, 01/05/25	1 884 518	0,04	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
Canada (suite)				Canada (suite)			
2 514 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.250%, 01/06/25	1 859 170	0,04	4 900 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.500%, 01/12/32	3 546 276	0,07
47 000 CAD	Canadian Government Bond, 9.000%, 01/06/25	38 011	0,00	5 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/06/33	3 689 178	0,08
3 300 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.500%, 01/08/25	2 481 157	0,05	Canada – Total			
10 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 0.500%, 01/09/25	7 170 787	0,15	85 244 995 1,79			
1 700 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.000%, 01/10/25	1 269 353	0,03	Chili			
3 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 4.500%, 01/11/25	2 299 575	0,05	500 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.500%, 01/03/26	563 308	0,01
2 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 4.500%, 01/02/26	1 539 709	0,03	1 200 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.000%, 01/10/28	1 356 214	0,03
7 050 000 CAD	Canadian Government Bond, 0.250%, 01/03/26	4 974 992	0,10	750 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.700%, 01/09/30	829 142	0,02
2 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.000%, 01/04/26	1 495 040	0,03	500 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 6.000%, 01/04/33	609 627	0,01
1 687 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/06/26	1 219 179	0,02	Chili – Total			
4 550 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.000%, 01/09/26	3 235 966	0,07	3 358 291 0,07			
3 350 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.250%, 01/03/27	2 379 653	0,05	Chine			
1 782 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.000%, 01/06/27	1 254 319	0,03	40 000 000 CNY	China Government Bond, 2.260%, 24/02/25	5 644 172	0,12
93 000 CAD	Canadian Government Bond, 8.000%, 01/06/27	81 216	0,00	20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.770%, 08/03/25	2 883 055	0,06
500 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.245%, 24/08/27	378 344	0,01	40 000 000 CNY	China Government Bond, 2.350%, 15/03/25	5 650 771	0,12
3 000 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.750%, 01/09/27	2 231 935	0,05	75 000 000 CNY	China Government Bond, 1.990%, 09/04/25	10 545 494	0,22
3 850 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.500%, 01/03/28	2 951 268	0,06	10 000 000 CNY	China Government Bond, 3.640%, 09/04/25	1 441 076	0,03
1 734 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.000%, 01/06/28	1 254 842	0,03	25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.240%, 25/05/25	3 526 550	0,07
4 200 000 CAD	Canadian Government Bond, 3.250%, 01/09/28	3 197 300	0,07	25 000 000 CNY	China Government Bond, 3.610%, 07/06/25	3 608 683	0,08
1 500 000 CAD	Canadian Government Bond, 4.000%, 01/03/29	1 184 427	0,02	75 000 000 CNY	China Government Bond, 2.000%, 15/06/25	10 543 484	0,22
1 981 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.250%, 01/06/29	1 442 678	0,03	60 000 000 CNY	China Government Bond, 2.180%, 25/08/25	8 455 007	0,18
1 185 000 CAD	Canadian Government Bond, 5.750%, 01/06/29	1 017 100	0,02	25 000 000 CNY	China Government Bond, 3.600%, 06/09/25	3 615 239	0,08
1 800 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.250%, 01/12/29	1 307 669	0,03	90 000 000 CNY	China Government Bond, 2.220%, 25/09/25	12 695 454	0,27
9 250 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.250%, 01/06/30	6 273 038	0,13	20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.990%, 15/10/25	2 859 987	0,06
7 700 000 CAD	Canadian Government Bond, 0.500%, 01/12/30	4 910 108	0,10	45 000 000 CNY	China Government Bond, 3.020%, 22/10/25	6 440 935	0,14
8 400 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/06/31	5 698 699	0,12	43 000 000 CNY	China Government Bond, 2.280%, 25/11/25	6 066 697	0,13
7 050 000 CAD	Canadian Government Bond, 1.500%, 01/12/31	4 750 329	0,10	20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.220%, 06/12/25	2 877 922	0,06
4 550 000 CAD	Canadian Government Bond, 2.000%, 01/06/32	3 172 198	0,07	55 000 000 CNY	China Government Bond, 2.460%, 15/02/26	7 786 251	0,16
				50 000 000 CNY	China Government Bond, 3.030%, 11/03/26	7 175 277	0,15
				20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.900%, 05/05/26	2 862 328	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
60 000 000 CNY	China Government Bond, 2.300%, 15/05/26	8 469 812	0,18	43 000 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 25/09/29	6 101 135	0,13
50 000 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 06/06/26	7 232 735	0,15	40 000 000 CNY	China Government Bond, 3.130%, 21/11/29	5 843 546	0,12
10 000 000 CNY	China Government Bond, 2.740%, 04/08/26	1 425 778	0,03	38 000 000 CNY	China Government Bond, 2.790%, 15/12/29	5 434 886	0,11
80 000 000 CNY	China Government Bond, 2.690%, 12/08/26	11 391 895	0,24	52 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 25/03/30	7 438 606	0,16
85 000 000 CNY	China Government Bond, 2.180%, 15/08/26	11 951 559	0,25	45 000 000 CNY	China Government Bond, 2.680%, 21/05/30	6 395 188	0,13
45 000 000 CNY	China Government Bond, 2.390%, 15/11/26	6 363 272	0,13	55 000 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 25/06/30	7 791 990	0,16
30 000 000 CNY	China Government Bond, 3.120%, 05/12/26	4 335 538	0,09	80 000 000 CNY	China Government Bond, 2.600%, 15/09/30	11 326 697	0,24
35 000 000 CNY	China Government Bond, 2.370%, 20/01/27	4 938 404	0,10	43 000 000 CNY	China Government Bond, 3.270%, 19/11/30	6 362 147	0,13
53 000 000 CNY	China Government Bond, 2.480%, 15/04/27	7 498 108	0,16	53 000 000 CNY	China Government Bond, 3.020%, 27/05/31	7 710 715	0,16
5 000 000 CNY	China Government Bond, 3.520%, 04/05/27	736 661	0,02	25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.890%, 18/11/31	3 604 876	0,08
85 000 000 CNY	China Government Bond, 2.850%, 04/06/27	12 177 117	0,26	42 000 000 CNY	China Government Bond, 2.750%, 17/02/32	5 988 858	0,13
70 000 000 CNY	China Government Bond, 2.500%, 25/07/27	9 915 499	0,21	40 000 000 CNY	China Government Bond, 2.760%, 15/05/32	5 708 807	0,12
15 000 000 CNY	China Government Bond, 3.590%, 03/08/27	2 211 697	0,05	40 000 000 CNY	China Government Bond, 2.690%, 15/08/32	5 678 633	0,12
75 000 000 CNY	China Government Bond, 2.440%, 15/10/27	10 596 148	0,22	58 000 000 CNY	China Government Bond, 2.600%, 01/09/32	8 178 653	0,17
63 000 000 CNY	China Government Bond, 3.280%, 03/12/27	9 215 933	0,19	62 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 15/11/32	8 885 105	0,19
55 000 000 CNY	China Government Bond, 2.640%, 15/01/28	7 828 516	0,16	38 000 000 CNY	China Government Bond, 2.880%, 25/02/33	5 487 877	0,12
10 000 000 CNY	China Government Bond, 3.850%, 01/02/28	1 504 061	0,03	55 000 000 CNY	China Government Bond, 2.670%, 25/05/33	7 804 941	0,16
60 000 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 15/04/28	8 542 822	0,18	86 000 000 CNY	China Government Bond, 2.520%, 25/08/33	12 067 186	0,25
60 000 000 CNY	China Government Bond, 3.010%, 13/05/28	8 686 049	0,18	25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.670%, 25/11/33	3 559 297	0,08
20 000 000 CNY	China Government Bond, 3.690%, 17/05/28	3 000 197	0,06	Chine – Total		435 310 496	9,13
75 000 000 CNY	China Government Bond, 2.400%, 15/07/28	10 577 959	0,22	Colombie			
30 000 000 CNY	China Government Bond, 3.540%, 16/08/28	4 463 495	0,09	4 000 000 COP	Colombian TES, 6.250%, 26/11/25	979 143	0,02
25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.480%, 25/09/28	3 535 927	0,07	11 000 000 COP	Colombian TES, 5.750%, 03/11/27	2 511 203	0,05
60 000 000 CNY	China Government Bond, 2.910%, 14/10/28	8 654 409	0,18	5 000 000 COP	Colombian TES, 7.750%, 18/09/30	1 174 471	0,02
65 000 000 CNY	China Government Bond, 2.550%, 15/10/28	9 230 803	0,19	11 000 000 COP	Colombian TES, 7.000%, 26/03/31	2 448 764	0,05
21 000 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 22/11/28	3 080 831	0,06	7 000 000 COP	Colombian TES, 13.250%, 09/02/33	2 151 280	0,05
50 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 24/03/29	7 166 253	0,15	Colombie – Total		9 264 861	0,19
55 000 000 CNY	China Government Bond, 3.290%, 23/05/29	8 098 235	0,17				
45 000 000 CNY	China Government Bond, 2.750%, 15/06/29	6 433 258	0,14				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
Croatie				République tchèque (suite)			
1 000 000 EUR	Croatia Government International Bond, 1.125%, 19/06/29	1 006 469	0,02	4 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.500%, 11/11/32	188 775	0,00
1 000 000 EUR	Croatia Government International Bond, 1.500%, 17/06/31	992 208	0,02	25 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.000%, 13/10/33	959 391	0,02
500 000 EUR	Croatia Government International Bond, 2.875%, 22/04/32	541 864	0,01	République tchèque – Total			
800 000 EUR	Croatia Government International Bond, 1.125%, 04/03/33	745 559	0,02	14 813 524 0,31			
Croatie – Total				Danemark			
3 286 100 0,07				10 920 000 DKK	Denmark Government Bond, 1.750%, 15/11/25	1 597 784	0,03
Chypre				12 940 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.500%, 15/11/27	1 806 233	0,04
500 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 0.010%, 09/02/26	522 201	0,01	9 500 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.500%, 15/11/29	1 286 432	0,03
150 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 1.500%, 16/04/27	159 799	0,00	13 000 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.010%, 15/11/31	1 631 292	0,03
147 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 2.375%, 25/09/28	159 969	0,00	2 000 000 DKK	Denmark Government Bond, 0.010%, 15/11/31	251 187	0,00
100 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 0.625%, 21/01/30	97 642	0,00	5 000 000 DKK	Denmark Government Bond, 2.250%, 15/11/33	740 603	0,02
200 000 EUR	Cyprus Government International Bond, 4.125%, 13/04/33	239 468	0,01	Danemark – Total			
Chypre – Total				7 313 531 0,15			
1 179 079 0,02				Finlande			
République tchèque				1 014 000 EUR	Finland Government Bond, 4.000%, 04/07/25	1 142 069	0,02
14 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.250%, 14/02/25	602 217	0,01	1 318 000 EUR	Finland Government Bond, 0.875%, 15/09/25	1 416 386	0,03
7 620 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.400%, 17/09/25	329 115	0,01	1 099 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/04/26	1 163 556	0,02
25 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 6.000%, 26/02/26	1 163 265	0,02	800 000 EUR	Finland Government Bond, 0.010%, 15/09/26	830 122	0,02
9 980 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.000%, 26/06/26	413 398	0,01	200 000 EUR	Finland Government Bond, 1.375%, 15/04/27	214 311	0,00
22 140 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.250%, 10/02/27	883 516	0,02	1 736 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/27	1 801 001	0,04
18 780 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.500%, 25/08/28	796 219	0,02	1 089 000 EUR	Finland Government Bond, 2.750%, 04/07/28	1 228 347	0,03
25 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.500%, 12/12/28	1 211 588	0,03	1 118 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/28	1 137 422	0,02
15 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.750%, 29/03/29	733 912	0,01	1 800 000 EUR	Finland Government Bond, 2.875%, 15/04/29	2 044 045	0,04
22 200 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.750%, 23/07/29	942 380	0,02	1 050 000 EUR	Finland Government Bond, 0.500%, 15/09/29	1 049 868	0,02
15 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.050%, 29/11/29	541 922	0,01	850 000 EUR	Finland Government Bond, 0.010%, 15/09/30	802 579	0,02
29 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.950%, 15/05/30	1 095 350	0,02	750 000 EUR	Finland Government Bond, 0.750%, 15/04/31	738 622	0,02
30 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.000%, 30/09/30	1 442 012	0,03	700 000 EUR	Finland Government Bond, 0.125%, 15/09/31	648 197	0,01
23 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.200%, 13/03/31	866 452	0,02	800 000 EUR	Finland Government Bond, 1.500%, 15/09/32	815 108	0,02
25 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 6.200%, 16/06/31	1 297 764	0,03	1 500 000 EUR	Finland Government Bond, 3.000%, 15/09/33	1 718 664	0,04
35 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.750%, 23/06/32	1 346 248	0,03	Finlande – Total			
				16 750 297 0,35			

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
France				France (suite)			
5 050 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/25	5 397 629	0,11	7 250 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.750%, perpetual	8 201 643	0,17
9 503 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/03/25	10 139 316	0,21	7 750 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.000%, perpetual	8 906 134	0,19
8 650 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/25	9 271 911	0,19	France – Total			
5 008 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 6.000%, 25/10/25	5 870 264	0,12	270 924 232			
7 423 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/11/25	7 983 015	0,17	5,68			
9 350 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/26	9 824 242	0,21	Allemagne			
8 709 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/04/26	9 865 911	0,21	5 170 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 11/04/25	5 517 665	0,12
9 910 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/26	10 483 474	0,22	5 950 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/10/25	6 302 532	0,13
9 400 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 24/09/26	10 427 219	0,22	1 250 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/10/25	1 328 217	0,03
7 774 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.250%, 25/11/26	8 111 113	0,17	5 800 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 10/04/26	6 097 963	0,13
8 050 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/02/27	8 292 639	0,17	4 500 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 09/10/26	4 691 609	0,10
7 855 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.000%, 25/05/27	8 329 165	0,17	4 950 000 EUR	Bundesobligation, 0.010%, 16/04/27	5 121 783	0,11
10 698 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.750%, 25/10/27	12 037 590	0,25	5 150 000 EUR	Bundesobligation, 1.300%, 15/10/27	5 554 746	0,12
9 600 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/02/28	9 993 284	0,21	1 500 000 EUR	Bundesobligation, 1.300%, 15/10/27	1 621 897	0,03
12 268 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/05/28	12 728 031	0,27	5 650 000 EUR	Bundesobligation, 2.200%, 13/04/28	6 301 127	0,13
11 876 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.750%, 25/11/28	12 233 960	0,26	5 500 000 EUR	Bundesobligation, 2.400%, 19/10/28	6 201 644	0,13
5 969 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 5.500%, 25/04/29	7 643 367	0,16	5 410 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/25	5 821 674	0,12
11 625 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.500%, 25/05/29	11 723 957	0,25	6 140 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.000%, 15/08/25	6 619 296	0,14
9 500 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/29	9 208 010	0,19	6 470 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/26	6 887 147	0,14
12 050 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.500%, 25/05/30	13 480 484	0,28	6 306 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/26	6 594 501	0,14
10 750 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/30	10 154 897	0,21	5 551 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/27	5 807 228	0,12
11 950 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 1.500%, 25/05/31	12 462 525	0,26	1 942 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.500%, 04/07/27	2 465 106	0,05
10 700 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/11/31	9 817 253	0,21	6 149 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/08/27	6 448 726	0,14
7 200 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 0.010%, 25/05/32	6 505 709	0,14	4 600 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/27	4 713 091	0,10
6 500 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 5.750%, 25/10/32	9 024 252	0,19	2 176 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.625%, 04/01/28	2 739 350	0,06
8 950 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 2.000%, 25/11/32	9 521 901	0,20	5 323 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.500%, 15/02/28	5 554 121	0,12
2 750 000 EUR	French Republic Government Bond OAT, 3.500%, 25/11/33	3 285 337	0,07	1 777 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.750%, 04/07/28	2 198 381	0,05
				5 878 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/08/28	6 027 641	0,13
				5 350 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/11/28	5 394 005	0,11
				6 060 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250%, 15/02/29	6 170 025	0,13
				5 923 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/29	5 896 214	0,12

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)				
Allemagne (suite)				Hongrie (suite)				
5 200 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.100%, 15/11/29	5 802 254	0,12	156 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.750%, 22/12/26	411 570	0,01	
2 100 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 6.250%, 04/01/30	2 882 888	0,06	156 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 27/10/27	411 824	0,01	
5 150 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/30	5 072 494	0,11	300 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 4.500%, 23/03/28	825 923	0,02	
6 500 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/30	6 347 894	0,13	12 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 6.750%, 22/10/28	37 519	0,00	
1 650 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/30	1 612 974	0,03	130 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.000%, 23/05/29	313 487	0,01	
2 450 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.400%, 15/11/30	2 786 773	0,06	200 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 21/08/30	494 952	0,01	
2 800 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 5.500%, 04/01/31	3 812 055	0,08	200 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.250%, 22/10/31	491 385	0,01	
5 700 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/31	5 507 365	0,12	225 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 4.750%, 24/11/32	599 355	0,01	
6 250 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/31	5 977 883	0,13	350 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.250%, 20/04/33	764 525	0,02	
1 750 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/08/31	1 674 484	0,03	Hongrie – Total			6 653 876	0,14
5 900 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.010%, 15/02/32	5 575 927	0,12	Indonésie				
6 100 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.700%, 15/08/32	6 597 467	0,14	20 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.500%, 15/06/25	1 299 370	0,03	
7 250 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.300%, 15/02/33	8 212 055	0,17	15 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.250%, 15/02/26	987 144	0,02	
6 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.600%, 15/08/33	6 958 699	0,15	35 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 5.500%, 15/04/26	2 232 048	0,05	
1 000 000 EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2.300%, perpetual	1 133 393	0,02	35 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 5.125%, 15/04/27	2 193 314	0,05	
400 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.200%, 12/12/24	438 356	0,01	25 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/05/27	1 651 296	0,04	
3 250 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.500%, 13/03/25	3 576 363	0,07	6 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.125%, 15/05/28	384 901	0,01	
4 000 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 3.100%, 18/09/25	4 461 196	0,09	25 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.375%, 15/08/28	1 619 634	0,03	
2 500 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 3.100%, 12/12/25	2 798 106	0,06	10 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.875%, 15/04/29	660 388	0,01	
5 750 000 EUR	Bundesschatzanweisungen, 2.800%, perpetual	6 363 870	0,13	20 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.250%, 15/05/29	1 399 961	0,03	
Allemagne – Total		215 668 185	4,53	55 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/09/30	3 655 998	0,08	
Hong Kong				60 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.500%, 15/02/31	3 888 017	0,08	
200 000 HKD	Hong Kong Government Bond Programme, 1.250%, 29/06/27	23 966	0,00	60 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.375%, 15/04/32	3 856 219	0,08	
Hong-Kong – Total		23 966	0,00	50 008 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/02/33	3 363 206	0,07	
Hongrie				10 000 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.125%, 15/10/25	642 242	0,01	
48 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 5.500%, 24/06/25	137 127	0,00	10 000 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.000%, 15/01/27	637 182	0,01	
200 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.000%, 26/11/25	525 552	0,01	15 000 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 5.875%, 15/07/28	947 883	0,02	
50 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.500%, 22/04/26	130 297	0,00	10 000 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.625%, 15/09/29	650 308	0,01	
100 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.500%, 26/08/26	257 779	0,00	10 000 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 8.875%, 15/11/31	734 539	0,02	
400 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 9.500%, 21/10/26	1 252 581	0,03	Indonésie – Total			30 803 650	0,65

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets			
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)						
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)						
Irlande				Italie (suite)						
1 996 000 EUR	Ireland Government Bond, 5.400%, 13/03/25	2 267 170	0,05	3 750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.850%, 01/07/25	4 072 058	0,09			
1 669 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.000%, 15/05/26	1 790 508	0,04	3 550 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.200%, 15/08/25	3 812 961	0,08			
2 250 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.200%, 15/05/27	2 329 102	0,05	3 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.600%, 29/09/25	3 348 714	0,07			
1 699 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.900%, 15/05/28	1 782 642	0,04	4 168 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 15/11/25	4 575 314	0,10			
2 344 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.100%, 15/05/29	2 450 772	0,05	4 434 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.000%, 01/12/25	4 821 071	0,10			
1 300 000 EUR	Ireland Government Bond, 2.400%, 15/05/30	1 451 267	0,03	3 850 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.500%, 15/01/26	4 307 893	0,09			
1 600 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.200%, 18/10/30	1 540 625	0,03	4 100 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.500%, 01/02/26	4 316 109	0,09			
1 000 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.350%, 18/03/31	1 039 067	0,02	4 589 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.500%, 01/03/26	5 245 294	0,11			
2 050 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.010%, 18/10/31	1 900 237	0,04	3 850 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/04/26	3 993 901	0,08			
1 000 000 EUR	Ireland Government Bond, 0.350%, 18/10/32	931 253	0,02	3 050 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.800%, 15/04/26	3 442 665	0,07			
1 000 000 EUR	Ireland Government Bond, 1.300%, 15/05/33	1 004 746	0,02	4 730 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.600%, 01/06/26	5 082 980	0,11			
Irlande – Total		18 487 389	0,39	3 450 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.100%, 15/07/26	3 748 694	0,08			
Israël				3 650 000 EUR				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.010%, 01/08/26	3 755 904	0,08
1 800 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 0.500%, 30/04/25	478 355	0,01	3 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 15/09/26	3 573 042	0,07			
2 755 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.750%, 31/08/25	739 946	0,02	1 562 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 7.250%, 01/11/26	1 933 485	0,04			
5 000 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 0.500%, 27/02/26	1 296 509	0,03	4 424 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.250%, 01/12/26	4 682 159	0,10			
2 165 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 6.250%, 30/10/26	642 784	0,01	4 700 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.850%, 15/01/27	4 903 085	0,10			
2 645 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 2.000%, 31/03/27	697 922	0,01	2 850 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.100%, 01/04/27	2 984 512	0,06			
4 260 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 2.250%, 28/09/28	1 111 275	0,02	3 600 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.200%, 01/06/27	3 900 347	0,08			
3 500 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 3.750%, 28/02/29	973 390	0,02	3 947 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.050%, 01/08/27	4 247 303	0,09			
3 400 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.000%, 31/03/30	799 386	0,02	4 250 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 15/09/27	4 388 054	0,09			
4 500 000 ILS	Israel Government Bond - Fixed, 1.300%, 30/04/32	1 017 052	0,02	3 259 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.500%, 01/11/27	4 072 382	0,09			
Israël – Total		7 756 619	0,16	3 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.650%, 01/12/27	3 836 466	0,08			
Italie				5 815 000 EUR				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.000%, 01/02/28	6 210 729	0,13
928 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 01/12/24	1 017 714	0,02	4 100 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.250%, 15/03/28	4 060 307	0,09			
3 350 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.350%, 01/02/25	3 588 857	0,08	3 750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.400%, 01/04/28	4 220 109	0,09			
4 356 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.000%, 01/03/25	4 910 114	0,10	3 100 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.500%, 15/07/28	3 074 646	0,06			
3 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.400%, 28/03/25	3 655 261	0,08	3 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.800%, 01/08/28	4 342 364	0,09			
3 258 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.450%, 15/05/25	3 523 300	0,07	5 460 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.750%, 01/09/28	6 496 169	0,14			
4 571 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.500%, 01/06/25	4 942 713	0,10							

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
Italie (suite)				Japon			
5 134 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 01/12/28	5 629 420	0,12	700 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/12/24	4 972 393	0,10
2 250 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.100%, 01/02/29	2 606 729	0,05	1 360 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/03/25	9 661 614	0,20
3 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.450%, 15/02/29	3 058 437	0,06	1 850 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/06/25	13 145 655	0,28
3 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.800%, 15/06/29	3 810 446	0,08	1 800 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/09/25	12 788 580	0,27
4 418 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.000%, 01/08/29	4 861 945	0,10	1 690 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/12/25	12 007 775	0,25
4 800 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.250%, 01/11/29	5 906 732	0,12	1 775 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/03/26	12 584 269	0,26
4 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.850%, 15/12/29	5 036 944	0,11	1 650 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/06/26	11 696 414	0,25
5 400 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.500%, 01/03/30	6 077 374	0,13	1 700 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/09/26	12 046 148	0,25
4 600 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.350%, 01/04/30	4 555 568	0,10	1 550 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/12/26	10 976 107	0,23
3 650 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/08/30	3 486 245	0,07	875 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/03/27	6 193 769	0,13
2 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 15/11/30	2 303 814	0,05	630 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/03/27	4 473 277	0,09
4 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.650%, 01/12/30	4 468 564	0,09	1 680 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.005%, 20/06/27	11 880 834	0,25
5 450 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.900%, 01/04/31	5 091 525	0,11	1 500 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/09/27	10 639 169	0,22
4 100 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 6.000%, 01/05/31	5 326 634	0,11	1 100 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.200%, 20/12/27	7 822 422	0,16
4 750 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.600%, 01/08/31	4 287 973	0,09	600 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.300%, 20/12/27	4 283 927	0,09
2 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.000%, 30/10/31	2 475 033	0,05	1 200 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/03/28	8 489 800	0,18
4 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/12/31	4 134 319	0,09	600 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.200%, 20/03/28	4 262 732	0,09
5 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.650%, 01/03/32	4 830 248	0,10	600 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.100%, 20/06/28	4 241 240	0,09
4 500 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0.950%, 01/06/32	4 071 089	0,09	650 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.200%, 20/06/28	4 614 456	0,10
3 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.500%, 01/12/32	3 212 968	0,07	700 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.300%, 20/06/28	4 990 864	0,10
5 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 5.750%, 01/02/33	6 450 494	0,14	700 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.300%, 20/09/28	4 984 757	0,10
4 300 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.400%, 01/05/33	5 062 118	0,11	750 000 000 JPY	Japan Government Five Year Bond, 0.400%, 20/09/28	5 365 548	0,11
4 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2.450%, 01/09/33	4 011 206	0,08	462 200 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.300%, 20/12/24	3 289 593	0,07
4 000 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.350%, 01/11/33	4 679 607	0,10	359 600 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.500%, 20/12/24	2 564 388	0,05
3 150 000 EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.700%, perpetual	3 570 014	0,07	1 605 100 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/03/25	11 446 100	0,24
Italie – Total		252 092 122	5,29	1 681 600 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/06/25	12 001 528	0,25
				1 650 900 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/09/25	11 790 386	0,25
				1 802 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.300%, 20/12/25	12 853 662	0,27
				1 911 300 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/26	13 581 238	0,29

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
1 548 700 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/26	11 005 569	0,23	1 364 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.800%, 20/09/33	9 840 576	0,21
1 881 400 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/26	13 367 308	0,28	30 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.800%, 20/09/29	243 577	0,01
1 731 600 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/26	12 301 140	0,26	70 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.900%, 20/11/30	583 143	0,01
1 646 400 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/27	11 690 164	0,25	50 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.400%, 20/11/31	407 813	0,01
1 630 900 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/27	11 575 017	0,24	100 000 000 JPY	Japan Government Thirty Year Bond, 2.300%, 20/05/32	814 406	0,02
1 648 400 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/27	11 689 048	0,25	134 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/12/24	973 840	0,02
1 570 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/27	11 129 093	0,23	108 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/24	785 073	0,02
2 047 700 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/28	14 500 354	0,30	100 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/03/25	726 096	0,02
1 654 300 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/28	11 698 968	0,25	118 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/03/25	864 365	0,02
1 743 300 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/28	12 301 159	0,26	121 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/25	880 516	0,02
1 708 500 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/28	12 046 270	0,25	114 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/06/25	836 339	0,02
1 500 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/29	10 566 286	0,22	75 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/25	549 886	0,01
1 549 900 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/29	10 912 844	0,23	110 500 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/09/25	810 825	0,02
1 710 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/29	12 028 464	0,25	241 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/25	1 777 222	0,04
1 750 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/29	12 297 790	0,26	228 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/12/25	1 685 953	0,04
1 700 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/30	11 944 978	0,25	141 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/25	1 047 834	0,02
2 015 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/30	14 132 728	0,30	163 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/26	1 215 648	0,03
2 021 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/30	14 118 759	0,30	141 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/26	1 055 262	0,02
2 020 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/30	14 074 233	0,30	141 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/03/26	1 057 144	0,02
1 910 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/03/31	13 270 016	0,28	100 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/06/26	747 219	0,02
1 950 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/06/31	13 508 778	0,28	234 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/06/26	1 754 257	0,04
1 930 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/09/31	13 331 895	0,28	275 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/09/26	2 066 069	0,04
1 880 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.100%, 20/12/31	12 949 037	0,27	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/09/26	1 505 249	0,03
1 980 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.200%, 20/03/32	13 732 476	0,29	398 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/26	3 002 219	0,06
1 780 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.200%, 20/06/32	12 298 515	0,26	300 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/03/27	2 260 193	0,05
1 875 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.200%, 20/09/32	12 939 468	0,27	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/27	1 511 945	0,03
1 750 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.500%, 20/12/32	12 355 387	0,26	133 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/27	1 013 505	0,02
1 850 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.500%, 20/03/33	13 030 965	0,27	308 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/06/27	2 356 985	0,05
1 875 000 000 JPY	Japan Government Ten Year Bond, 0.400%, 20/06/33	13 057 304	0,27	133 600 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/27	1 017 485	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
Japon (suite)				Japon (suite)			
221 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/09/27	1 688 962	0,04	220 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/31	1 762 403	0,04
335 200 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/27	2 562 314	0,05	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/06/31	1 562 746	0,03
250 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/28	1 924 883	0,04	400 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/06/31	3 145 184	0,07
121 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.400%, 20/03/28	938 844	0,02	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/09/31	1 553 483	0,03
100 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/28	769 868	0,02	400 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/09/31	3 131 849	0,07
150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.300%, 20/06/28	1 164 208	0,02	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/12/31	1 555 114	0,03
107 300 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.400%, 20/06/28	836 176	0,02	300 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/12/31	2 349 269	0,05
208 800 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/28	1 611 883	0,03	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/03/32	1 545 326	0,03
71 900 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/09/28	557 513	0,01	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/03/32	1 556 547	0,03
252 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/12/28	1 938 853	0,04	400 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/03/32	3 143 453	0,07
321 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/28	2 487 670	0,05	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.500%, 20/06/32	1 535 523	0,03
222 700 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/03/29	1 715 965	0,04	250 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/06/32	1 935 363	0,04
283 400 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/29	2 204 280	0,05	200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/06/32	1 561 030	0,03
331 300 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/06/29	2 587 327	0,05	700 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/09/32	5 462 612	0,11
207 100 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/06/29	1 625 246	0,03	250 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/12/32	1 950 667	0,04
650 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/09/29	5 095 294	0,11	300 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/12/32	2 359 250	0,05
400 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/29	3 145 694	0,07	600 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/03/33	4 646 191	0,10
200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/12/29	1 581 600	0,03	1 050 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/06/33	8 205 164	0,17
420 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/03/30	3 316 504	0,07	1 000 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.700%, 20/09/33	7 815 222	0,16
200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.200%, 20/03/30	1 587 530	0,03	80 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/12/24	567 797	0,01
200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.600%, 20/06/30	1 537 041	0,03	585 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/01/25	4 151 641	0,09
200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/06/30	1 555 100	0,03	500 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/02/25	3 548 659	0,07
150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/06/30	1 180 689	0,03	650 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/03/25	4 612 520	0,10
200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.800%, 20/09/30	1 557 469	0,03	800 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/04/25	5 678 706	0,12
270 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/09/30	2 115 089	0,04	700 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/05/25	4 969 563	0,10
150 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/12/30	1 184 147	0,03	800 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/06/25	5 676 777	0,12
350 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.100%, 20/12/30	2 783 217	0,06	850 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/07/25	6 030 852	0,13
200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 1.900%, 20/03/31	1 571 031	0,03	800 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/08/25	5 676 607	0,12
200 000 000 JPY	Japan Government Twenty Year Bond, 2.000%, 20/03/31	1 582 111	0,03	800 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/09/25	5 674 394	0,12

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
Japon (suite)				Corée (suite)			
950 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.005%, 01/10/25	6 737 129	0,14	3 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.375%, 10/12/31	2 193 991	0,05
800 000 000 JPY	Japan Government Two Year Bond, 0.100%, 01/11/25	5 685 005	0,12	4 800 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.375%, 10/06/32	3 770 187	0,08
Japon – Total				3 300 000 000 KRW			
		827 085 856	17,35			2 765 475	0,06
Corée				Corée – Total			
3 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/03/25	2 279 479	0,05			72 713 104	1,53
3 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.375%, 10/03/25	2 330 142	0,05	Lettonie			
2 500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.125%, 10/06/25	1 935 900	0,04	300 000 EUR	Latvia Government International Bond, 3.875%, 25/03/27	341 512	0,01
3 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.125%, 10/09/25	2 247 382	0,05	300 000 EUR	Latvia Government International Bond, 3.500%, 17/01/28	338 865	0,01
1 900 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.250%, 10/12/25	1 447 912	0,03	100 000 EUR	Latvia Government International Bond, 1.125%, 30/05/28	102 390	0,00
3 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 4.250%, 10/12/25	2 372 608	0,05	200 000 EUR	Latvia Government International Bond, 0.250%, 23/01/30	186 098	0,00
3 300 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.250%, 10/03/26	2 457 289	0,05	900 000 EUR	Latvia Government International Bond, 0.010%, perpetual	795 607	0,02
1 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.875%, 10/06/26	752 132	0,02	Lettonie – Total			
5 500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.125%, 10/06/26	4 266 933	0,09			1 764 472	0,04
3 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.750%, 10/09/26	2 243 458	0,05	Lituanie			
1 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/12/26	739 602	0,02	127 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 2.125%, 29/10/26	137 082	0,00
2 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.875%, 10/12/26	1 582 899	0,03	42 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 0.950%, 26/05/27	43 151	0,00
3 500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.375%, 10/03/27	2 651 558	0,06	500 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 4.125%, 25/04/28	572 065	0,01
2 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.125%, 10/06/27	1 498 998	0,03	350 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 3.875%, 14/06/33	406 091	0,01
3 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.125%, 10/09/27	2 324 170	0,05	350 000 EUR	Lithuania Government International Bond, 0.750%, perpetual	332 604	0,01
1 200 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.375%, 10/12/27	904 041	0,02	Lituanie – Total			
7 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.250%, 10/03/28	5 446 643	0,11			1 490 993	0,03
3 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.625%, 10/06/28	2 276 779	0,05	Luxembourg			
5 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 3.500%, 10/09/28	3 935 835	0,08	200 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 0.010%, 28/04/25	212 594	0,00
1 500 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.375%, 10/12/28	1 122 517	0,02	200 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 0.010%, 13/11/26	206 621	0,00
2 650 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.875%, 10/06/29	1 923 939	0,04	384 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 0.625%, 01/02/27	401 619	0,01
5 000 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.375%, 10/12/29	3 510 534	0,07	42 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 2.250%, 19/03/28	46 253	0,00
5 800 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.375%, 10/06/30	4 028 353	0,08	100 000 EUR	Luxembourg Government Bond, 0.010%, 28/04/30	95 421	0,00
3 600 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 1.500%, 10/12/30	2 501 004	0,05	300 000 EUR	State of the Grand-Duchy of Luxembourg, 1.375%, 25/05/29	315 647	0,01
4 100 000 000 KRW	Korea Treasury Bond, 2.000%, 10/06/31	2 929 479	0,06	300 000 EUR	State of the Grand-Duchy of Luxembourg, 0.010%, 24/03/31	279 280	0,01
Luxembourg – Total						1 557 435	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)				
Malaisie				Mexique (suite)				
2 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.882%, 14/03/25	438 067	0,01	51 650 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 31/05/29	2 995 453	0,06	
1 595 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.955%, 15/09/25	350 463	0,01	78 500 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 29/05/31	4 340 411	0,09	
3 145 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.392%, 15/04/26	698 792	0,01	65 000 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 26/05/33	3 491 872	0,07	
5 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.906%, 15/07/26	1 099 597	0,02	Mexique – Total			27 164 739	0,57
420 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.900%, 30/11/26	92 487	0,00	Pays-Bas				
4 750 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.899%, 16/11/27	1 046 396	0,02	3 358 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/25	3 582 479	0,08	
6 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.519%, 20/04/28	1 302 764	0,03	2 600 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/26	2 736 930	0,06	
2 770 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.733%, 15/06/28	606 320	0,01	4 059 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/26	4 295 636	0,09	
40 000 MYR	Malaysia Government Bond, 5.248%, 15/09/28	9 319	0,00	2 850 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/27	2 949 504	0,06	
5 500 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.504%, 30/04/29	1 245 777	0,03	3 921 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/27	4 130 619	0,09	
6 220 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.885%, 15/08/29	1 367 087	0,03	1 697 000 EUR	Netherlands Government Bond, 5.500%, 15/01/28	2 114 033	0,04	
11 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 2.632%, 15/04/31	2 219 439	0,05	4 249 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.750%, 15/07/28	4 418 328	0,09	
11 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.582%, 15/07/32	2 353 593	0,05	2 800 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/01/29	2 781 986	0,06	
1 680 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.128%, 15/08/25	370 024	0,01	2 736 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.250%, 15/07/29	2 730 155	0,06	
4 600 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.726%, 31/03/26	1 006 674	0,02	2 650 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/30	2 547 415	0,05	
3 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.070%, 30/09/26	773 184	0,02	2 600 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.010%, 15/07/31	2 438 749	0,05	
840 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.258%, 26/07/27	187 021	0,00	3 500 000 EUR	Netherlands Government Bond, 0.500%, 15/07/32	3 338 065	0,07	
5 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.422%, 30/09/27	1 082 339	0,02	2 520 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/01/33	2 833 547	0,06	
2 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.599%, 31/07/28	435 238	0,01	2 200 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, 15/07/33	2 466 198	0,05	
5 840 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.369%, 31/10/28	1 312 481	0,03	1 300 000 EUR	Netherlands Government Bond, 2.500%, perpetual	1 463 416	0,03	
5 650 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.130%, 09/07/29	1 255 714	0,03	Pays-Bas – Total			44 827 060	0,94
12 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.465%, 15/10/30	2 670 593	0,06	Nouvelle-Zélande				
9 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.193%, 07/10/32	2 124 072	0,04	1 045 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.750%, 15/04/25	643 314	0,01	
5 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.724%, 15/06/33	1 164 331	0,02	600 000 NZD	New Zealand Government Bond, 0.500%, 15/05/26	346 904	0,01	
Malaisie – Total			25 211 772	0,53	2 960 000 NZD	New Zealand Government Bond, 4.500%, 15/04/27	1 886 849	0,04
Mexique				1 100 000 NZD	New Zealand Government Bond, 0.250%, 15/05/28	588 074	0,01	
15 000 000 MXN	Mexican Bonos, 5.000%, 06/03/25	838 076	0,02	2 804 000 NZD	New Zealand Government Bond, 3.000%, 20/04/29	1 678 826	0,03	
75 225 000 MXN	Mexican Bonos, 5.750%, 05/03/26	4 095 541	0,09	1 500 000 NZD	New Zealand Government Bond, 4.500%, 15/05/30	964 683	0,02	
20 000 000 MXN	Mexican Bonos, 7.000%, 03/09/26	1 112 096	0,02	2 500 000 NZD	New Zealand Government Bond, 1.500%, 15/05/31	1 308 183	0,03	
104 500 000 MXN	Mexican Bonos, 5.500%, 04/03/27	5 526 723	0,12	1 450 000 NZD	New Zealand Government Bond, 2.000%, 15/05/32	770 919	0,02	
69 575 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 03/06/27	3 898 164	0,08	3 000 000 NZD	New Zealand Government Bond, 3.500%, 14/04/33	1 779 423	0,04	
15 000 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 01/03/29	866 403	0,02	Nouvelle-Zélande – Total			9 967 175	0,21

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
Norvège				Portugal			
1 640 000 NOK	Norway Government Bond, 1.750%, 13/03/25	157 544	0,00	3 061 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.875%, 15/10/25	3 407 404	0,07
8 140 000 NOK	Norway Government Bond, 1.500%, 19/02/26	767 640	0,02	1 565 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.875%, 21/07/26	1 759 740	0,04
9 360 000 NOK	Norway Government Bond, 1.750%, 17/02/27	878 295	0,02	1 323 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4.125%, 14/04/27	1 546 889	0,03
9 680 000 NOK	Norway Government Bond, 2.000%, 26/04/28	905 492	0,02	1 250 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.700%, 15/10/27	1 305 862	0,03
7 500 000 NOK	Norway Government Bond, 1.750%, 06/09/29	680 765	0,02	3 353 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 2.125%, 17/10/28	3 686 632	0,08
6 000 000 NOK	Norway Government Bond, 1.375%, 19/08/30	524 602	0,01	3 118 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.950%, 15/06/29	3 384 265	0,07
10 000 000 NOK	Norway Government Bond, 1.250%, 17/09/31	851 975	0,02	1 100 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 3.875%, 15/02/30	1 317 355	0,03
7 500 000 NOK	Norway Government Bond, 2.125%, 18/05/32	676 630	0,01	2 300 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.475%, 18/10/30	2 233 525	0,04
2 000 000 NOK	Norway Government Bond, 3.000%, 15/08/33	192 670	0,00	1 550 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 0.300%, 17/10/31	1 444 179	0,03
Norvège – Total		5 635 613	0,12	1 800 000 EUR	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.650%, 16/07/32	1 841 787	0,04
Pérou				Portugal – Total			
2 500 000 PEN	Peru Government Bond, 6.350%, 12/08/28	690 866	0,02			21 927 638	0,46
3 400 000 PEN	Peru Government Bond, 5.940%, 12/02/29	917 970	0,02	Roumanie			
4 000 000 PEN	Peru Government Bond, 6.150%, 12/08/32	1 056 285	0,02	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 3.650%, 28/07/25	428 821	0,01
Pérou – Total		2 665 121	0,06	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.850%, 22/04/26	432 725	0,01
Pologne				2 500 000 RON	Romania Government Bond, 3.250%, 24/06/26	519 273	0,01
3 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 0.750%, 25/04/25	722 334	0,01	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 7.200%, 31/05/27	456 128	0,01
1 475 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.250%, 25/07/25	365 201	0,01	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 2.500%, 25/10/27	389 715	0,01
9 540 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/26	2 285 645	0,05	1 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.150%, 26/01/28	206 388	0,00
8 500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 0.250%, 25/10/26	1 900 900	0,04	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 5.000%, 12/02/29	420 211	0,01
10 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.750%, 25/05/27	2 450 633	0,05	2 400 000 RON	Romania Government Bond, 4.850%, 25/07/29	498 231	0,01
8 710 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/27	2 047 429	0,04	5 000 000 RON	Romania Government Bond, 8.000%, 29/04/30	1 206 712	0,03
8 075 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/04/28	1 884 095	0,04	2 850 000 RON	Romania Government Bond, 4.150%, 24/10/30	561 489	0,01
9 500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 7.500%, 25/07/28	2 659 323	0,06	8 000 000 RON	Romania Government Bond, 3.650%, 24/09/31	1 495 959	0,03
150 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 5.750%, 25/04/29	39 416	0,00	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 6.700%, 25/02/32	454 650	0,01
9 500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/10/29	2 158 213	0,05	3 500 000 RON	Romania Government Bond, 8.250%, 29/09/32	877 464	0,02
8 400 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.250%, 25/10/30	1 690 916	0,04	Roumanie – Total		7 947 766	0,17
8 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.750%, 25/04/32	1 582 056	0,03	Singapour			
6 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 6.000%, 25/10/33	1 617 700	0,03	439 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.375%, 01/06/25	327 834	0,01
Pologne – Total		21 403 861	0,45	1 300 000 SGD	Singapore Government Bond, 0.500%, 01/11/25	937 358	0,02
				1 210 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.125%, 01/06/26	897 112	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)					
Singapour (suite)				Slovénie (suite)					
2 000 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.250%, 01/11/26	1 447 184	0,03	368 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.188%, 14/03/29	377 283	0,01		
419 000 SGD	Singapore Government Bond, 3.500%, 01/03/27	323 479	0,00	200 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.275%, 14/01/30	191 034	0,00		
1 131 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.625%, 01/05/28	855 894	0,02	300 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.875%, 15/07/30	294 627	0,01		
2 000 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/08/28	1 529 315	0,03	300 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.010%, 12/02/31	272 311	0,01		
1 297 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/07/29	990 326	0,02	200 000 EUR	Slovenia Government Bond, 0.125%, 01/07/31	182 082	0,00		
700 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.875%, 01/09/30	534 841	0,01	500 000 EUR	Slovenia Government Bond, 2.250%, 03/03/32	529 293	0,01		
2 000 000 SGD	Singapore Government Bond, 1.625%, 01/07/31	1 403 790	0,03	500 000 EUR	Slovenia Government Bond, 3.625%, 11/03/33	584 940	0,01		
3 000 000 SGD	Singapore Government Bond, 2.625%, 01/08/32	2 257 676	0,05	Slovénie – Total			3 633 786	0,08	
2 000 000 SGD	Singapore Government Bond, 3.375%, 01/09/33	1 602 259	0,03	Espagne					
Singapour – Total				13 107 068				0,27	
Slovaquie				3 200 000 EUR Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/25				3 421 481	0,07
800 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.250%, 14/05/25	850 660	0,02	3 318 000 EUR	Spain Government Bond, 1.600%, 30/04/25	3 600 684	0,08		
188 000 EUR	Slovakia Government Bond, 4.350%, 14/10/25	212 341	0,00	4 800 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/05/25	5 088 584	0,11		
242 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.625%, 22/05/26	254 082	0,01	5 006 000 EUR	Spain Government Bond, 4.650%, 30/07/25	5 680 457	0,12		
335 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.375%, 21/01/27	355 045	0,01	3 931 000 EUR	Spain Government Bond, 2.150%, 31/10/25	4 300 736	0,09		
700 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.125%, 17/06/27	706 794	0,01	4 950 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/26	5 176 846	0,11		
826 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.000%, 12/06/28	845 970	0,02	4 520 000 EUR	Spain Government Bond, 1.950%, 30/04/26	4 918 423	0,10		
433 000 EUR	Slovakia Government Bond, 3.625%, 16/01/29	496 418	0,01	5 300 000 EUR	Spain Government Bond, 2.800%, 31/05/26	5 878 884	0,12		
400 000 EUR	Slovakia Government Bond, 0.750%, 09/04/30	387 865	0,01	4 410 000 EUR	Spain Government Bond, 5.900%, 30/07/26	5 264 540	0,11		
400 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.000%, 09/10/30	388 704	0,01	5 567 000 EUR	Spain Government Bond, 1.300%, 31/10/26	5 944 683	0,12		
700 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.625%, 21/01/31	708 665	0,01	4 550 000 EUR	Spain Government Bond, 0.010%, 31/01/27	4 652 514	0,10		
700 000 EUR	Slovakia Government Bond, 1.000%, 14/05/32	655 202	0,01	4 999 000 EUR	Spain Government Bond, 1.500%, 30/04/27	5 342 732	0,11		
1 200 000 EUR	Slovakia Government Bond, 4.000%, 19/10/32	1 413 850	0,03	4 350 000 EUR	Spain Government Bond, 0.800%, 30/07/27	4 524 891	0,10		
500 000 EUR	Slovakia Government Bond, 3.625%, 08/06/33	571 888	0,01	4 202 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 31/10/27	4 463 033	0,09		
Slovaquie – Total				7 847 484				0,16	
Slovénie				5 650 000 EUR Spain Government Bond, 1.400%, 30/04/28				5 956 546	0,13
384 000 EUR	Slovenia Government Bond, 2.125%, 28/07/25	419 405	0,01	5 250 000 EUR	Spain Government Bond, 1.400%, 30/07/28	5 519 650	0,12		
30 000 EUR	Slovenia Government Bond, 5.125%, 30/03/26	34 768	0,00	4 144 000 EUR	Spain Government Bond, 5.150%, 31/10/28	5 115 592	0,11		
389 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.250%, 22/03/27	410 539	0,01	3 373 000 EUR	Spain Government Bond, 6.000%, 31/01/29	4 330 936	0,09		
326 000 EUR	Slovenia Government Bond, 1.000%, 06/03/28	337 504	0,01	4 952 000 EUR	Spain Government Bond, 1.450%, 30/04/29	5 168 873	0,11		

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)				
Espagne (suite)				Suisse (suite)				
1 250 000 EUR	Spain Government Bond, 3.500%, 31/05/29	1 442 300	0,03	1 050 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.500%, 27/05/30	1 231 169	0,02	
5 250 000 EUR	Spain Government Bond, 0.800%, 30/07/29	5 259 894	0,11	1 000 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 2.250%, 22/06/31	1 321 428	0,03	
4 800 000 EUR	Spain Government Bond, 0.600%, 31/10/29	4 731 685	0,10	1 000 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 3.500%, 08/04/33	1 486 295	0,03	
5 100 000 EUR	Spain Government Bond, 0.500%, 30/04/30	4 934 290	0,10	Suisse – Total			7 145 874	0,15
4 200 000 EUR	Spain Government Bond, 1.950%, 30/07/30	4 438 314	0,09	Thaïlande				
4 950 000 EUR	Spain Government Bond, 1.250%, 31/10/30	4 976 279	0,10	40 000 000 THB	Thailand Government Bond, 0.950%, 17/06/25	1 148 758	0,02	
4 950 000 EUR	Spain Government Bond, 0.100%, 30/04/31	4 521 668	0,10	25 300 000 THB	Thailand Government Bond, 3.850%, 12/12/25	762 347	0,02	
4 650 000 EUR	Spain Government Bond, 0.500%, 31/10/31	4 320 465	0,09	50 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.350%, 17/06/26	1 464 792	0,03	
5 000 000 EUR	Spain Government Bond, 0.700%, 30/04/32	4 660 906	0,10	26 900 000 THB	Thailand Government Bond, 2.125%, 17/12/26	782 959	0,02	
4 550 000 EUR	Spain Government Bond, 5.750%, 30/07/32	6 135 783	0,13	50 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.250%, 17/03/27	1 457 936	0,03	
4 600 000 EUR	Spain Government Bond, 2.550%, 31/10/32	4 954 559	0,10	94 000 000 THB	Thailand Government Bond, 1.000%, 17/06/27	2 625 638	0,05	
5 500 000 EUR	Spain Government Bond, 3.150%, 30/04/33	6 176 795	0,13	100 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.650%, 17/06/28	2 956 039	0,06	
3 700 000 EUR	Spain Government Bond, 2.350%, 30/07/33	3 886 892	0,08	39 100 000 THB	Thailand Government Bond, 2.875%, 17/12/28	1 167 965	0,02	
5 000 000 EUR	Spain Government Bond, 3.550%, 31/10/33	5 784 666	0,12	25 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.400%, 17/03/29	729 832	0,02	
Espagne – Total			166 213 322	3,49	18 400 000 THB	Thailand Government Bond, 4.875%, 22/06/29	603 377	0,02
Suède				65 000 000 THB	Thailand Government Bond, 1.600%, 17/12/29	1 809 850	0,04	
5 630 000 SEK	Sweden Government Bond, 2.500%, 12/05/25	555 751	0,01	110 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.000%, 17/12/31	3 061 501	0,06	
8 620 000 SEK	Sweden Government Bond, 1.000%, 12/11/26	825 695	0,02	85 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.350%, 17/06/33	2 627 137	0,05	
12 780 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.750%, 12/05/28	1 199 953	0,02	Thaïlande – Total			21 198 131	0,44
8 500 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.750%, 12/11/29	786 030	0,02	Royaume-Uni				
9 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 0.125%, 12/05/31	781 560	0,02	4 850 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.250%, 31/01/25	5 917 908	0,12	
12 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 2.250%, 01/06/32	1 214 045	0,03	5 091 000 GBP	United Kingdom Gilt, 5.000%, 07/03/25	6 546 922	0,14	
10 000 000 SEK	Sweden Government Bond, 1.750%, 11/11/33	966 883	0,02	9 150 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.625%, 07/06/25	11 115 722	0,23	
7 000 000 SEK	Sweden Government International Bond, 0.125%, perpetual	615 214	0,01	7 766 000 GBP	United Kingdom Gilt, 2.000%, 07/09/25	9 601 804	0,20	
Suède – Total			6 945 131	0,15	7 800 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.500%, 22/10/25	9 864 685	0,21
Suisse				7 550 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.125%, 30/01/26	8 951 583	0,19	
650 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 1.250%, 28/05/26	777 482	0,02	8 785 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.500%, 22/07/26	10 650 134	0,22	
677 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 3.250%, 27/06/27	870 468	0,02	6 250 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.375%, 22/10/26	7 305 000	0,15	
116 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 4.000%, 08/04/28	156 274	0,00	6 550 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.125%, 29/01/27	8 479 779	0,18	
1 141 000 CHF	Swiss Confederation Government Bond, 0.010%, 22/06/29	1 302 758	0,03	8 651 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.250%, 22/07/27	10 240 541	0,21	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				États-Unis (suite)			
5 222 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/12/27	6 865 235	0,14	8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 28/02/25	8 493 359	0,18
6 500 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.125%, 31/01/28	7 272 879	0,15	10 550 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 15/03/25	10 195 586	0,21
4 250 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.500%, 07/06/28	5 650 055	0,12	8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/03/25	7 606 562	0,16
7 906 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.625%, 22/10/28	9 333 458	0,20	3 658 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/03/25	3 571 694	0,08
2 302 000 GBP	United Kingdom Gilt, 6.000%, 07/12/28	3 284 538	0,07	9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 31/03/25	9 417 246	0,20
6 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.500%, 31/01/29	6 641 987	0,14	9 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 15/04/25	9 070 769	0,19
8 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.875%, 22/10/29	8 907 178	0,19	8 100 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 30/04/25	7 665 574	0,16
8 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.375%, 22/10/30	8 352 997	0,18	4 268 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 30/04/25	4 174 804	0,09
7 200 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.750%, 07/12/30	9 932 943	0,21	9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/04/25	9 414 648	0,20
7 800 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.250%, 31/07/31	7 865 557	0,17	10 603 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.125%, 15/05/25	10 264 615	0,22
7 300 000 GBP	United Kingdom Gilt, 1.000%, 31/01/32	7 715 636	0,16	8 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/05/25	8 003 969	0,17
7 600 000 GBP	United Kingdom Gilt, 4.250%, 07/06/32	10 260 776	0,22	8 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/05/25	7 815 617	0,16
7 000 000 GBP	United Kingdom Gilt, 3.250%, 31/01/33	8 732 186	0,18	4 100 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 31/05/25	4 006 309	0,08
3 950 000 GBP	United Kingdom Gilt, 0.875%, 31/07/33	3 944 728	0,08	9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 31/05/25	9 464 746	0,20
Royaume-Uni – Total		193 434 231	4,06	8 450 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/06/25	8 259 215	0,17
États-Unis				9 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 30/06/25	9 017 250	0,19
3 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.000%, 15/12/24	3 230 395	0,07	3 575 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 30/06/25	3 487 859	0,07
1 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 31/12/24	970 430	0,02	9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 30/06/25	9 523 008	0,20
496 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 31/12/24	483 716	0,01	8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 15/07/25	8 315 059	0,17
2 850 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 31/12/24	2 834 971	0,06	9 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/07/25	8 990 250	0,19
8 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/01/25	7 947 715	0,17	4 900 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 31/07/25	4 783 051	0,10
4 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/01/25	4 535 500	0,10	9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.750%, 31/07/25	9 041 836	0,19
4 129 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 31/01/25	4 032 227	0,08	10 544 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/08/25	10 146 952	0,21
8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/01/25	8 447 207	0,18	9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/08/25	8 820 352	0,19
10 150 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 15/02/25	9 795 939	0,21	82 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.875%, 15/08/25	84 928	0,00
10 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/02/25	10 481 062	0,22	9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/08/25	8 870 254	0,19
78 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 7.625%, 15/02/25	80 593	0,00	3 742 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 31/08/25	3 643 042	0,08
6 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 28/02/25	5 954 180	0,13	9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.000%, 31/08/25	9 588 691	0,20
4 833 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 28/02/25	4 728 788	0,10	8 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 15/09/25	8 621 826	0,18

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
10 050 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 30/09/25	9 359 848	0,20	10 301 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/05/26	9 721 569	0,20
4 768 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 30/09/25	4 658 858	0,10	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 15/05/26	6 921 250	0,15
10 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.000%, 30/09/25	10 608 281	0,22	11 450 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/05/26	10 573 359	0,22
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.250%, 15/10/25	7 985 938	0,17	5 528 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.125%, 31/05/26	5 279 240	0,11
10 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.250%, 31/10/25	9 568 137	0,20	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 15/06/26	7 001 094	0,15
3 666 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, 31/10/25	3 581 081	0,08	10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.875%, 30/06/26	9 249 219	0,19
10 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.000%, 31/10/25	10 620 996	0,22	5 558 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 30/06/26	5 271 850	0,11
10 341 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/11/25	9 960 484	0,21	8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/07/26	8 581 680	0,18
8 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/11/25	8 780 420	0,18	11 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 31/07/26	10 627 594	0,22
9 900 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 30/11/25	9 195 012	0,19	4 678 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 31/07/26	4 426 923	0,09
4 158 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 30/11/25	4 050 964	0,09	10 422 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 15/08/26	9 755 969	0,20
12 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.875%, 30/11/25	12 126 094	0,25	8 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 15/08/26	8 761 172	0,18
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 15/12/25	7 958 750	0,17	80 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.750%, 15/08/26	84 962	0,00
11 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 31/12/25	10 381 437	0,22	12 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/08/26	11 556 562	0,24
3 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/12/25	3 586 398	0,08	3 758 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/08/26	3 504 335	0,07
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/01/26	7 940 625	0,17	8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 15/09/26	8 112 500	0,17
11 550 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 31/01/26	10 670 215	0,22	10 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.875%, 30/09/26	9 417 988	0,20
4 955 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/01/26	4 800 156	0,10	2 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 30/09/26	2 344 727	0,05
10 773 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/02/26	10 210 784	0,21	8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 15/10/26	8 121 875	0,17
8 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 15/02/26	8 164 125	0,17	11 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 31/10/26	10 799 648	0,23
165 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.000%, 15/02/26	170 195	0,00	4 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 31/10/26	4 026 883	0,08
12 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 28/02/26	11 089 688	0,23	10 520 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, 15/11/26	9 950 441	0,21
5 805 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 28/02/26	5 603 186	0,12	10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 15/11/26	10 161 719	0,21
8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 15/03/26	8 576 367	0,18	604 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.500%, 15/11/26	642 080	0,01
11 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/03/26	10 487 812	0,22	10 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/11/26	9 711 680	0,20
4 408 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 31/03/26	4 228 925	0,09	3 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 30/11/26	3 272 500	0,07
7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 15/04/26	6 936 562	0,15	11 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 31/12/26	10 618 633	0,22
11 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 30/04/26	10 179 297	0,21	4 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 31/12/26	4 030 242	0,08
3 173 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 30/04/26	3 049 550	0,06	14 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 31/01/27	13 559 750	0,28

Tableau des investissements (suite)
au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
8 419 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/02/27	7 994 761	0,17	8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 31/01/28	7 879 375	0,17
73 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.625%, 15/02/27	78 378	0,00	10 667 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/02/28	10 201 152	0,21
2 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 28/02/27	2 107 555	0,04	12 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 29/02/28	11 183 594	0,23
9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 28/02/27	8 909 961	0,19	7 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 29/02/28	7 530 469	0,16
3 650 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 31/03/27	3 281 863	0,07	10 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 31/03/28	9 245 055	0,19
10 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.500%, 31/03/27	10 231 039	0,21	9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 31/03/28	9 403 516	0,20
5 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 30/04/27	4 912 187	0,10	12 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/04/28	10 931 391	0,23
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 30/04/27	9 624 219	0,20	8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 30/04/28	8 372 500	0,18
9 922 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/05/27	9 429 001	0,20	12 928 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/28	12 407 850	0,26
5 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/05/27	4 632 469	0,10	11 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 31/05/28	9 835 547	0,21
8 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/05/27	8 428 063	0,18	7 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 31/05/28	7 427 930	0,16
7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 30/06/27	6 220 703	0,13	11 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/06/28	10 263 750	0,22
9 400 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.250%, 30/06/27	9 189 969	0,19	9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 30/06/28	9 050 625	0,19
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 31/07/27	7 060 625	0,15	11 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.000%, 31/07/28	10 341 836	0,22
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 31/07/27	7 684 375	0,16	8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/07/28	8 595 625	0,18
8 327 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/08/27	7 856 004	0,16	12 070 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/08/28	11 560 797	0,24
292 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.375%, 15/08/27	314 858	0,01	637 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.500%, 15/08/28	680 744	0,01
6 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/08/27	5 967 949	0,13	12 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 31/08/28	11 045 898	0,23
8 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 31/08/27	8 023 125	0,17	9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 31/08/28	9 201 094	0,19
9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.375%, 30/09/27	8 338 477	0,18	12 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 30/09/28	11 308 652	0,24
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 30/09/27	8 054 375	0,17	9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 30/09/28	9 298 828	0,20
8 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.500%, 31/10/27	7 479 336	0,16	11 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/10/28	9 801 172	0,21
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/10/27	8 055 000	0,17	11 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.875%, 31/10/28	11 492 422	0,24
9 560 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, 15/11/27	8 993 869	0,19	11 566 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 15/11/28	11 186 491	0,23
695 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.125%, 15/11/27	748 700	0,02	1 274 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.250%, 15/11/28	1 350 042	0,03
8 900 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 30/11/27	7 849 383	0,16	10 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 30/11/28	9 397 500	0,20
8 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/11/27	8 187 187	0,17	11 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 30/11/28	11 268 125	0,24
9 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 31/12/27	8 992 266	0,19	14 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 31/12/28	12 877 812	0,27
10 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.750%, 31/01/28	9 263 789	0,19	10 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 31/01/29	9 483 633	0,20

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 98,47 % (suite)				Obligations d'État – 98,47 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
12 693 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 15/02/29	11 966 127	0,25	18 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 15/08/30	14 871 609	0,31
628 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.250%, 15/02/29	665 925	0,01	5 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 31/08/30	5 831 758	0,12
9 600 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 28/02/29	8 715 000	0,18	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.625%, 30/09/30	7 308 437	0,15
10 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 31/03/29	9 294 531	0,20	6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.875%, 31/10/30	6 886 953	0,14
9 100 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 30/04/29	8 667 750	0,18	18 650 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.875%, 15/11/30	15 348 367	0,32
9 565 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.375%, 15/05/29	8 879 757	0,19	7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, 30/11/30	7 211 094	0,15
7 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 31/05/29	7 091 602	0,15	19 100 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.125%, 15/02/31	15 972 375	0,34
8 700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.250%, 30/06/29	8 433 562	0,18	1 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 5.375%, 15/02/31	1 969 312	0,04
7 400 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.625%, 31/07/29	6 939 812	0,15	19 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/05/31	16 582 922	0,35
9 534 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, 15/08/29	8 496 433	0,18	22 200 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, 15/08/31	18 412 125	0,39
603 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.125%, 15/08/29	669 142	0,01	23 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, 15/11/31	19 341 094	0,41
6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, 31/08/29	6 252 187	0,13	20 650 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.875%, 15/02/32	17 788 039	0,37
7 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/09/29	7 296 578	0,15	19 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, 15/05/32	17 965 266	0,38
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 31/10/29	8 050 000	0,17	18 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, 15/08/32	17 206 055	0,36
7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, 15/11/29	6 256 797	0,13	19 300 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, 15/11/32	19 658 859	0,41
8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 30/11/29	7 997 500	0,17	19 550 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 15/02/33	18 997 102	0,40
6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 31/01/30	6 366 953	0,13	19 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, 15/05/33	18 275 625	0,38
11 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 1.500%, 15/02/30	9 902 875	0,21	22 350 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, 15/08/33	22 367 461	0,47
6 800 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 28/02/30	6 843 031	0,14	8 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.500%, 15/11/33	8 416 250	0,18
6 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, 31/03/30	5 916 094	0,12	9 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, perpetual	8 357 773	0,18
7 000 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, 30/04/30	6 852 891	0,14	6 250 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, perpetual	6 248 047	0,13
15 400 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, 15/05/30	12 606 344	0,26	États-Unis – Total		1 664 704 233	34,93
700 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 6.250%, 15/05/30	791 437	0,02	Total des obligations d'État		4 692 976 958	98,47
6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 31/05/30	6 452 266	0,14	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé		4 692 976 958	98,47
6 500 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, 30/06/30	6 452 266	0,14	TOTAL DES INVESTISSEMENTS		4 692 976 958	98,47
6 750 000 USD	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, 31/07/30	6 798 516	0,14				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – (0,37) %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold EUR, due 04/01/24	Bank of Montreal	1 317 000	805 295	9 080	0,00
Bought AUD / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	3 584 000	2 194 024	21 900	0,00
Bought AUD / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	1 879 000	1 148 954	12 936	0,00
Bought AUD / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	5 537 000	3 654 733	123 561	0,00
Bought AUD / Sold USD, due 04/01/24	Citibank NA	971 000	643 172	19 410	0,00
Bought AUD / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 766 000	1 831 725	55 715	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	5 393 000	3 679 132	25 764	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	29 475 000	20 177 384	64 167	0,00
Bought CAD / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	1 898 000	1 294 958	8 922	0,00
Bought CAD / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	61 387 000	36 492 094	35 814	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	5 608 000	4 141 061	112 072	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	14 302 000	10 839 812	6 889	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 866 000	2 117 995	55 592	0,00
Bought CHF / Sold AUD, due 04/01/24	UBS AG	6 619 791	11 432 000	64 378	0,00
Bought CHF / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 241 883	5 570 000	59 873	0,00
Bought CHF / Sold AUD, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	180 032	311 000	2 177	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 04/01/24	UBS AG	7 399 251	11 495 000	73 505	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 514 895	5 457 000	49 602	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	204 465	317 000	3 219	0,00
Bought CHF / Sold CLP, due 04/01/24	UBS AG	250 534	248 931 000	12 625	0,00
Bought CHF / Sold CLP, due 05/02/24	UBS AG	247 893	248 931 000	11 012	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	337 135	2 772 000	9 672	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	561 303	4 601 000	18 100	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 04/01/24	UBS AG	37 720 628	307 253 000	1 490 360	0,03
Bought CHF / Sold CNY, due 05/02/24	UBS AG	17 712 367	148 752 000	72 654	0,00
Bought CHF / Sold CNY, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	1 062 578	8 766 000	26 672	0,00
Bought CHF / Sold COP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	830 497	3 820 257 000	10 484	0,00
Bought CHF / Sold CZK, due 04/01/24	UBS AG	1 413 158	35 798 000	77 352	0,00
Bought CHF / Sold CZK, due 05/02/24	UBS AG	697 939	18 350 000	11 840	0,00
Bought CHF / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	698 653	5 421 000	26 752	0,00
Bought CHF / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	484 106	3 831 000	8 466	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	3 015 607	3 193 050	55 632	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	47 226 201	49 152 999	1 812 505	0,04
Bought CHF / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	48 613 287	50 621 001	1 838 870	0,04
Bought CHF / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	21 952 213	23 327 001	367 740	0,01
Bought CHF / Sold EUR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	21 954 672	23 326 999	370 674	0,01
Bought CHF / Sold EUR, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	2 622 682	2 777 000	54 920	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	16 466 724	14 863 000	617 363	0,01
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 942 000	2 706 180	45 659	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 04/01/24	Citibank NA	359 427	327 000	10 189	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	7 514 019	6 930 000	121 472	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold GBP, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	468 524	429 000	11 537	0,00
Bought CHF / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	643 109	254 156 000	29 668	0,00
Bought CHF / Sold HUF, due 05/02/24	UBS AG	447 100	182 311 000	8 456	0,00
Bought CHF / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	2 620 804	46 494 376 000	94 214	0,00
Bought CHF / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 231 356	22 154 566 000	29 450	0,00
Bought CHF / Sold ILS, due 04/01/24	UBS AG	839 141	3 525 000	18 087	0,00
Bought CHF / Sold ILS, due 05/02/24	UBS AG	617 135	2 627 000	5 678	0,00
Bought CHF / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	16 496 851	2 752 411 000	47 278	0,00
Bought CHF / Sold JPY, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	16 498 147	2 752 411 000	48 823	0,00
Bought CHF / Sold JPY, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	1 990 670	327 372 000	39 638	0,00
Bought CHF / Sold KRW, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	6 414 942	9 474 701 000	264 669	0,01
Bought CHF / Sold KRW, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	3 302 917	4 995 431 000	51 561	0,00
Bought CHF / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 464 560	48 771 000	48 717	0,00
Bought CHF / Sold MXN, due 06/02/24	UBS AG	1 274 135	25 558 000	18 009	0,00
Bought CHF / Sold MYR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	363 721	1 947 000	8 404	0,00
Bought CHF / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	1 944 063	10 329 000	61 802	0,00
Bought CHF / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	1 204 032	6 522 000	12 810	0,00
Bought CHF / Sold NOK, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	481 155	5 739 000	8 017	0,00
Bought CHF / Sold NZD, due 04/01/24	UBS AG	1 010 609	1 880 000	10 426	0,00
Bought CHF / Sold NZD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	519 071	965 000	7 717	0,00
Bought CHF / Sold PEN, due 04/01/24	Merrill Lynch International	34 098	145 000	1 352	0,00
Bought CHF / Sold PEN, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	33 554	145 000	875	0,00
Bought CHF / Sold PLN, due 04/01/24	UBS AG	1 964 873	8 890 000	73 781	0,00
Bought CHF / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	991 867	4 577 000	18 966	0,00
Bought CHF / Sold RON, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	859 429	4 456 000	31 694	0,00
Bought CHF / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	415 452	2 198 000	7 372	0,00
Bought CHF / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	760 526	8 995 000	11 026	0,00
Bought CHF / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	402 008	4 725 000	9 766	0,00
Bought CHF / Sold SGD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 175 300	1 790 000	39 374	0,00
Bought CHF / Sold SGD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	565 285	878 000	7 276	0,00
Bought CHF / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	1 527 787	60 871 000	31 713	0,00
Bought CHF / Sold THB, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	1 015 282	41 064 000	3 747	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	47 435 238	54 252 002	2 107 813	0,05
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 525 661	2 937 825	63 020	0,00
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	47 405 125	54 251 999	2 072 038	0,05
Bought CHF / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	50 385 461	57 647 999	2 217 101	0,05
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	21 277 349	25 041 668	322 963	0,01
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Goldman Sachs International	21 269 640	25 041 666	313 775	0,01
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	21 290 174	25 041 666	338 254	0,01
Bought CHF / Sold USD, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	4 077 718	4 722 000	139 029	0,00
Bought CNY / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	825 002 000	104 270 663	1 150 199	0,03
Bought CNY / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 710 872 000	188 359 793	1 135 401	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	89 707 000	12 573 115	76 870	0,00
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	81 501 000	11 409 591	83 230	0,00
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	461 843 000	64 677 294	449 245	0,01
Bought CNY / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 666 000	514 794	3 792	0,00
Bought CNY / Sold USD, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	8 129 000	1 141 074	8 840	0,00
Bought COP / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	11 719 332 000	2 713 618	26 821	0,00
Bought COP / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	15 089 183 000	3 011 873	54 674	0,00
Bought COP / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	4 599 208 000	1 169 158	17 810	0,00
Bought CZK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	105 478 000	4 269 553	2 776	0,00
Bought CZK / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	7 892 000	350 130	2 976	0,00
Bought CZK / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	8 662 000	383 413	4 144	0,00
Bought EUR / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	19 352 323	31 314 000	15 112	0,00
Bought EUR / Sold CLP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	268 686	257 420 000	2 050	0,00
Bought EUR / Sold CLP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	270 774	257 420 000	5 294	0,00
Bought EUR / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 262 089	17 610 000	15 648	0,00
Bought EUR / Sold CNY, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	1 617 200	12 504 000	23 264	0,00
Bought EUR / Sold CNY, due 04/01/24	UBS AG	127 718 635	999 231 000	183 788	0,01
Bought EUR / Sold CZK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 333 825	105 478 000	68 225	0,00
Bought EUR / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 542 758	18 953 000	289	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 024 542	884 000	4 875	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	22 141	19 000	238	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	56 038 687	48 542 000	23 857	0,00
Bought EUR / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	2 290 361	869 435 000	17 729	0,00
Bought EUR / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	8 921 875	151 689 719 000	19 393	0,00
Bought EUR / Sold KRW, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	20 216 307	28 699 473 000	47 387	0,00
Bought EUR / Sold KRW, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	1 443 377	2 045 468 000	6 163	0,00
Bought EUR / Sold PEN, due 04/01/24	Standard Chartered Bank	476 634	1 946 000	976	0,00
Bought EUR / Sold PEN, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	476 235	1 946 000	1 671	0,00
Bought EUR / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	6 527 893	28 375 000	7 652	0,00
Bought EUR / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	2 786 074	13 883 000	19	0,00
Bought EUR / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 202 386	24 371 000	14 550	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	267 117 072	293 170 258	1 911 942	0,04
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	13 115 168	14 329 867	158 361	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	220 730 250	243 004 927	834 106	0,02
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	159 685 165	175 512 999	889 991	0,02
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	10 902 000	11 796 204	247 153	0,01
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	23 951 000	25 939 615	518 872	0,01
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 955 364	3 249 245	19 606	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	2 821 000	3 087 629	32 606	0,00
Bought GBP / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	31 633 796	58 905 000	97 153	0,00
Bought GBP / Sold CLP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	411 140	451 407 000	7 228	0,00
Bought GBP / Sold CLP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	409 442	451 407 000	6 143	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought GBP / Sold CNY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	20 275 125	182 984 000	43 471	0,00
Bought GBP / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	142 093 022	1 282 603 000	275 540	0,01
	Westpac Banking Corporation	27 157 968	245 285 000	32 421	0,00
Bought GBP / Sold CNY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	3 108 377	87 312 000	56 048	0,00
Bought GBP / Sold CZK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 083 049	144 852 000	6 746	0,00
Bought GBP / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 683 462	14 479 000	421	0,00
Bought GBP / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 578 675	22 116 000	5 209	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	241 685 139	277 570 000	1 142 717	0,03
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	4 100 441	4 726 000	877	0,00
	Goldman Sachs International	235 949 793	271 149 000	932 082	0,02
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 058 476	463 967 000	8 622	0,00
Bought GBP / Sold HUF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 561 316	1 133 541 000	4 424	0,00
Bought GBP / Sold IDR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 203 639	82 307 251 000	13 210	0,00
Bought GBP / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	6 222 252	121 796 915 000	21 813	0,00
Bought GBP / Sold KRW, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	16 569 663	27 001 094 000	156 508	0,01
	Goldman Sachs International	4 932 178	28 798 000	19 926	0,00
Bought GBP / Sold MYR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 399 285	31 022 000	2 009	0,00
Bought GBP / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	741 740	3 466 000	9 508	0,00
Bought GBP / Sold PEN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 251 048	36 273 000	25 015	0,00
Bought GBP / Sold PLN, due 05/02/24	UBS AG	3 011 650	17 276 000	5 221	0,00
Bought GBP / Sold RON, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 723 980	34 691 000	26 328	0,00
Bought GBP / Sold SEK, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	241 202 623	305 481 478	2 005 191	0,05
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	61 955 460	77 841 004	1 140 218	0,02
	Goldman Sachs International	173 300 804	219 904 235	1 020 755	0,02
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	3 528 349	4 454 000	43 963	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	155 210 343	196 868 333	994 819	0,02
	Westpac Banking Corporation	107 896 757	136 458 480	1 089 004	0,03
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	246 211 339	312 985 333	941 421	0,02
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	6 523 026	8 265 416	51 635	0,00
	Goldman Sachs International	235 888 159	300 169 333	595 059	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	236 072 007	300 169 334	829 471	0,02
	Westpac Banking Corporation	29 153 013	36 926 201	244 754	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	869 435 000	2 273 569	821	0,00
Bought HUF / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	204 104 166 000	10 370 620	35 437	0,00
Bought IDR / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	11 120 525 000	718 775	3 471	0,00
Bought IDR / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	77 108 910 000	4 973 228	34 770	0,00
	Merrill Lynch International	12 083 365 000	779 381	5 398	0,00
Bought IDR / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	9 628 000	2 402 479	19 802	0,00
Bought ILS / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	14 662 000	3 175 810	23 257	0,00
Bought ILS / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	5 956 000	1 645 305	8 742	0,00
Bought ILS / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 306 715 000	31 583 769	115 603	0,01
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	3 118 124 000	18 553 117	73 748	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	21 025 627 000	133 169 013	2 028 279	0,04
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	114 130 000	730 212	2 887	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	15 231 812 000	96 703 777	1 214 432	0,03
Bought JPY / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 216 894 000	14 010 992	247 047	0,01
Bought JPY / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	94 967 000	604 578	8 194	0,00
Bought JPY / Sold EUR, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	91 756 000	590 776	573	0,00
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	160 505 000	868 889	30 830	0,00
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	31 957 031 500	176 382 777	1 823 858	0,04
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	Merrill Lynch International	31 957 031 500	176 314 657	1 910 698	0,04
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	3 458 230 000	23 666 075	863 859	0,01
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 689 614 000	53 896 553	647 452	0,01
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	2 569 808 000	17 551 403	676 771	0,02
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	7 191 077 000	50 445 998	561 783	0,01
Bought JPY / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 828 189 000	19 318 757	742 167	0,02
Bought JPY / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	39 076 000	273 783	4 742	0,00
Bought JPY / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	137 887 000	966 742	16 084	0,00
Bought JPY / Sold USD, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	303 609 000	2 138 000	26 054	0,00
Bought KRW / Sold EUR, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	27 908 722 000	19 507 177	121 958	0,00
Bought KRW / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	43 862 075 000	26 456 709	332 133	0,01
Bought KRW / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 573 513 000	1 209 492	12 356	0,00
Bought KRW / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	2 223 709 000	1 699 226	27 505	0,00
Bought KRW / Sold USD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 287 205 000	1 740 802	35 234	0,00
Bought KRW / Sold USD, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	12 049 424 000	9 225 145	131 346	0,00
Bought MXN / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	14 698 000	780 113	6 013	0,00
Bought MXN / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	150 552 000	8 022 396	26 594	0,00
Bought MXN / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	198 374 000	9 176 019	14 726	0,00
Bought MXN / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	20 195 000	1 155 454	36 896	0,00
Bought MXN / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	58 909 000	3 475 157	2 941	0,00
Bought MXN / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	11 524 000	658 861	21 538	0,00
Bought MYR / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	32 501 000	6 357 536	50 451	0,00
Bought MYR / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	49 333 000	8 325 121	124 002	0,00
Bought MYR / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	23 288 000	4 987 258	81 183	0,00
Bought NOK / Sold CHF, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 026 000	162 624	6 279	0,00
Bought NOK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	27 207 000	2 422 865	2 536	0,00
Bought NZD / Sold EUR, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	5 494 000	3 145 720	3 472	0,00
Bought NZD / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 823 000	3 883 035	3 013	0,00
Bought NZD / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	3 707 000	2 344 307	2 779	0,00
Bought PEN / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	3 466 000	732 467	2 313	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought PEN / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 865 000	502 063	1 620	0,00
Bought PLN / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 976 000	493 543	8 963	0,00
Bought PLN / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 141 000	533 730	10 737	0,00
Bought SEK / Sold CHF, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	2 184 000	182 017	459	0,00
Bought SEK / Sold CHF, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	2 086 000	173 956	312	0,00
Bought SGD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 567 000	3 805 000	17 145	0,00
Bought SGD / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 559 000	4 483 847	14 653	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	411 000	307 100	4 490	0,00
Bought SGD / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	3 243 000	2 453 942	4 667	0,00
Bought THB / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	206 975 000	5 410 858	87 017	0,00
Bought THB / Sold GBP, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	300 239 000	6 765 187	172 674	0,01
Bought THB / Sold USD, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	143 658 000	4 111 562	97 605	0,00
Bought USD / Sold AUD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	9 377 899	13 688 000	27 890	0,00
Bought USD / Sold CLP, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	396 479	343 135 000	4 313	0,00
Bought USD / Sold CZK, due 04/01/24	UBS AG	2 914 501	64 478 000	29 613	0,00
Bought USD / Sold CZK, due 05/02/24	UBS AG	2 144 018	47 924 000	2 010	0,00
Bought USD / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 466 372	9 857 000	3 298	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	141 911 334	128 368 462	103 669	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	70 126 096	63 372 690	31 201	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	67 578 910	61 040 000	64 144	0,00
Bought USD / Sold HUF, due 04/01/24	UBS AG	1 583 682	546 543 000	4 331	0,00
Bought USD / Sold HUF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 576 032	546 543 000	3 564	0,00
Bought USD / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 208 740	12 251 000	1 431	0,00
Bought USD / Sold PLN, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 374 201	13 228 000	11 757	0,00
Bought USD / Sold RON, due 05/02/24	UBS AG	1 860 457	8 364 000	3 916	0,00
Bought USD / Sold SEK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 267 835	12 658 000	10 162	0,00
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				49 347 678	1,04

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 800 000	1 615 679	(9 016)	(0,00)
Bought AUD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 570 000	3 249 520	(60 080)	(0,00)
Bought AUD / Sold CHF, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	3 062 000	1 766 376	(9 283)	(0,00)
Bought AUD / Sold CHF, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	269 000	155 902	(2 102)	(0,00)
Bought AUD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	31 314 000	19 358 439	(17 326)	(0,00)
Bought AUD / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	58 905 000	31 608 702	(99 859)	(0,00)
Bought AUD / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	13 688 000	9 368 780	(28 474)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 974 000	1 913 637	(18 179)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 457 000	3 525 039	(49 635)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	3 064 000	1 972 499	(19 858)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	274 000	175 861	(1 747)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold COP, due 04/01/24	UBS AG	817 064	3 820 257 000	(15 147)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	34 625 463	5 819 051 500	(135 744)	(0,01)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	619 397	105 145 000	(9 883)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	Citibank NA	747 501	125 679 000	(3 330)	(0,00)
Bought CHF / Sold JPY, due 04/01/24	UBS AG	34 601 580	5 819 051 500	(164 121)	(0,01)
Bought CHF / Sold NOK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	637 392	7 765 000	(7 302)	(0,00)
Bought CLP / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	248 931 000	249 321	(11 183)	(0,00)
Bought CLP / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	257 420 000	271 686	(5 364)	(0,00)
Bought CLP / Sold GBP, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	451 407 000	410 345	(6 214)	(0,00)
Bought CLP / Sold USD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	343 135 000	397 276	(4 360)	(0,00)
Bought CNY / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	15 521 000	1 894 114	(61 791)	(0,00)
Bought CNY / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	67 310 000	8 209 516	(262 390)	(0,01)
Bought CNY / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	230 850 000	27 752 374	(420 583)	(0,01)
	Westpac Banking Corporation	945 000	115 652	(4 152)	(0,00)
Bought CNY / Sold CHF, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	8 606 000	1 033 926	(15 150)	(0,00)
Bought CNY / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 293 000	155 624	(2 614)	(0,00)
Bought CNY / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	153 467 000	19 840 442	(276 520)	(0,01)
	Westpac Banking Corporation	50 876 000	6 581 466	(96 244)	(0,00)
Bought COP / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	3 820 257 000	838 596	(10 437)	(0,00)
Bought CZK / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	7 857 000	303 695	(9 293)	(0,00)
Bought CZK / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	18 350 000	701 029	(11 903)	(0,00)
	Westpac Banking Corporation	9 591 000	369 854	(10 317)	(0,00)
Bought CZK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	144 852 000	5 089 534	(7 173)	(0,00)
Bought CZK / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	47 924 000	2 146 405	(2 179)	(0,00)
Bought DKK / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	3 831 000	484 932	(8 446)	(0,00)
	Westpac Banking Corporation	1 590 000	201 273	(3 516)	(0,00)
Bought DKK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	18 953 000	2 542 562	(72)	(0,00)
Bought DKK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	22 116 000	2 574 960	(5 170)	(0,00)
Bought DKK / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	9 857 000	1 464 007	(3 282)	(0,00)
Bought EUR / Sold AUD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	22 970 416	38 094 000	(619 032)	(0,01)
Bought EUR / Sold CAD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	24 622 413	36 736 000	(660 552)	(0,02)
	JPMorgan Chase Bank NA London	20 453	30 000	(158)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	20 160 245	29 475 000	(65 369)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	28 892 001	27 253 392	(464 134)	(0,01)
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	108 000	101 998	(1 882)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	26 406 000	24 912 582	(429 186)	(0,01)
	Goldman Sachs International	23 326 999	21 999 693	(369 608)	(0,01)
Bought EUR / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	2 262 279	2 173 000	(82 712)	(0,00)
	Westpac Banking Corporation	21 931 000	20 691 949	(357 970)	(0,01)
Bought EUR / Sold CHF, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	2 854 000	2 682 891	(41 525)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 719 707	2 561 245	(45 052)	(0,00)
Bought EUR / Sold CNY, due 05/02/24	UBS AG	104 368 276	825 002 000	(1 264 182)	(0,03)
Bought EUR / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 602 492	11 719 332 000	(149 582)	(0,01)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold COP, due 05/02/24	Goldman Sachs International	2 693 505	11 719 332 000	(25 726)	(0,00)
Bought EUR / Sold CZK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	4 259 414	105 478 000	(3 208)	(0,00)
Bought EUR / Sold DKK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 543 402	18 953 000	(2)	(0,00)
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	272 510 000	237 028 554	(1 125 810)	(0,03)
Bought EUR / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	271 149 000	235 693 557	(927 433)	(0,02)
Bought EUR / Sold GBP, due 05/02/24	BNP Paribas SA	45 684 695	39 718 000	(110 968)	(0,00)
Bought EUR / Sold HUF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 260 834	869 435 000	(816)	(0,00)
Bought EUR / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	8 890 927	151 689 719 000	(30 064)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 385 383	9 628 000	(38 688)	(0,00)
Bought EUR / Sold ILS, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 400 722	9 628 000	(20 106)	(0,00)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 156 212	667 991 000	(146 861)	(0,01)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	Goldman Sachs International	118 362 747	19 111 099 500	(4 804 513)	(0,10)
Bought EUR / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	116 463 457	18 809 372 500	(4 762 432)	(0,10)
Bought EUR / Sold JPY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	97 054 074	15 231 812 000	(1 219 801)	(0,03)
Bought EUR / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	868 731	136 237 000	(10 185)	(0,00)
Bought EUR / Sold JPY, due 05/02/24	Goldman Sachs International	97 067 372	15 231 812 000	(1 205 092)	(0,03)
Bought EUR / Sold KRW, due 05/02/24	JPMorgan Chase Bank NA London	19 515 361	27 908 722 000	(124 123)	(0,00)
Bought EUR / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	8 693 761	165 250 000	(152 739)	(0,01)
Bought EUR / Sold MXN, due 06/02/24	UBS AG	7 968 100	150 552 000	(28 347)	(0,00)
Bought EUR / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	6 378 123	32 501 000	(27 710)	(0,00)
Bought EUR / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	6 363 138	32 501 000	(50 679)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 324 936	27 207 000	(110 718)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 421 689	27 207 000	(2 623)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	3 074 145	5 494 000	(82 541)	(0,00)
Bought EUR / Sold NZD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	3 142 109	5 494 000	(3 553)	(0,00)
Bought EUR / Sold PLN, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	6 529 382	28 375 000	(2 934)	(0,00)
Bought EUR / Sold RON, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 787 415	13 883 000	(3 409)	(0,00)
Bought EUR / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	2 145 233	24 371 000	(48 547)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	3 805 546	5 567 000	(16 541)	(0,00)
Bought EUR / Sold SGD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 805 600	5 567 000	(17 317)	(0,00)
Bought EUR / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	5 401 198	206 975 000	(97 689)	(0,00)
Bought EUR / Sold THB, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	5 414 821	206 975 000	(92 269)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	128 550 538	142 275 712	(89 287)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Goldman Sachs International	128 180 046	141 911 333	(134 699)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	128 203 206	141 911 334	(109 083)	(0,00)
Bought GBP / Sold AUD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 934 724	3 654 000	(26 988)	(0,00)
Bought GBP / Sold AUD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	20 383 210	38 981 000	(614 892)	(0,01)
Bought GBP / Sold AUD, due 04/01/24	Citibank NA	5 068 686	9 664 000	(132 848)	(0,00)
Bought GBP / Sold AUD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	3 461 472	6 606 000	(95 041)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 948 579	5 014 000	(43 771)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	7 100 243	12 116 000	(137 392)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought GBP / Sold CAD, due 04/01/24	UBS AG	21 801 625	37 517 000	(660 205)	(0,02)
Bought GBP / Sold CAD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	3 939 723	6 740 000	(89 261)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 05/02/24	HSBC Bank PLC Westpac Banking Corporation	36 501 641	61 387 000	(36 586)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	1 057 132	1 790 000	(10 284)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 116 000	4 522 525	(126 301)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 615 633	1 791 000	(68 344)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	4 144 000	4 553 509	(127 419)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	1 047 546	1 151 000	(32 133)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	6 930 000	7 537 789	(121 557)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	371 000	404 504	(9 171)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 714 663	2 942 000	(45 869)	(0,00)
Bought GBP / Sold CNY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	1 381 832	12 505 000	(7 057)	(0,00)
Bought GBP / Sold CNY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	1 641 332	14 812 000	(2 531)	(0,00)
Bought GBP / Sold CNY, due 05/02/24	HSBC Bank PLC Westpac Banking Corporation	188 744 222	1 710 872 000	(1 362 264)	(0,03)
Bought GBP / Sold CNY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	7 477 197	67 495 000	(14 068)	(0,00)
Bought GBP / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC JPMorgan Chase Bank NA London	1 394 654	7 196 161 000	(79 278)	(0,00)
Bought GBP / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 546 438	7 893 022 000	(65 628)	(0,00)
Bought GBP / Sold COP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	2 992 389	15 089 183 000	(53 616)	(0,00)
Bought GBP / Sold CZK, due 04/01/24	Merrill Lynch International	2 018 998	57 540 000	(634)	(0,00)
Bought GBP / Sold DKK, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	879 508	7 637 000	(10 537)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	58 632 907	67 994 093	(366 948)	(0,01)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	105 585 941	122 200 461	(392 281)	(0,02)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	5 825 222	6 786 000	(70 412)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	153 583 561	177 246 500	(13 544)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Royal Bank of Canada Westpac Banking Corporation	153 549 175	177 246 500	(57 379)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	42 465 486	49 252 565	(273 658)	(0,01)
Bought GBP / Sold EUR, due 05/02/24	Merrill Lynch International	18 528 650	21 410 000	(56 469)	(0,00)
Bought GBP / Sold HUF, due 04/01/24	Merrill Lynch International	1 505 577	669 574 000	(15 555)	(0,00)
Bought GBP / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	10 366 932	204 104 166 000	(33 865)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 455 440	6 778 000	(26 922)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 04/01/24	Merrill Lynch International	1 677 699	7 884 000	(50 733)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 176 818	14 662 000	(23 821)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	16 453 665	3 044 612 000	(620 817)	(0,02)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	28 939 764	5 279 802 000	(558 117)	(0,02)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Citibank NA	4 298 420	794 890 000	(158 664)	(0,01)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	UBS AG Westpac Banking Corporation	112 424 919	20 947 854 000	(5 267 401)	(0,11)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	184 341 452	34 007 410 000	(6 221 841)	(0,13)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	4 186 180	756 845 000	(57 110)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 082 031	557 056 000	(40 885)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	HSBC Bank PLC	177 241 692	31 957 031 500	(1 793 854)	(0,04)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	Merrill Lynch International Westpac Banking Corporation	177 170 942	31 957 031 500	(1 884 062)	(0,04)
Bought GBP / Sold JPY, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	14 043 604	2 523 365 000	(79 947)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought GBP / Sold KRW, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 822 595	3 000 721 000	(6 632)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought GBP / Sold KRW, due 04/01/24	London	1 929 739	3 183 607 000	(12 057)	(0,00)
Bought GBP / Sold KRW, due 04/01/24	UBS AG	6 463 256	10 676 653 000	(51 121)	(0,00)
Bought GBP / Sold KRW, due 05/02/24	UBS AG	26 494 904	43 862 075 000	(337 519)	(0,01)
Bought GBP / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 929 775	130 086 000	(121 207)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought GBP / Sold MXN, due 04/01/24	London	3 095 523	68 288 000	(85 659)	(0,00)
Bought GBP / Sold MXN, due 06/02/24	BNP Paribas SA	9 124 096	198 374 000	(17 074)	(0,00)
Bought GBP / Sold MYR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	3 491 159	20 535 000	(18 720)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought GBP / Sold MYR, due 05/02/24	International	8 341 308	49 333 000	(124 588)	(0,00)
Bought GBP / Sold NOK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 035 610	13 984 000	(56 794)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought GBP / Sold NOK, due 04/01/24	London	1 245 377	17 038 000	(90 107)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 973 642	4 070 000	(60 909)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	1 833 096	3 753 000	(39 369)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	3 882 777	7 823 000	(3 093)	(0,00)
Bought GBP / Sold PEN, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	731 480	3 466 000	(2 556)	(0,00)
Bought GBP / Sold PLN, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 904 826	14 685 000	(31 371)	(0,00)
Bought GBP / Sold PLN, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	4 305 088	21 588 000	(1 773)	(0,00)
Bought GBP / Sold RON, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 371 180	7 952 000	(17 710)	(0,00)
Bought GBP / Sold RON, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 622 377	9 324 000	(2 127)	(0,00)
Bought GBP / Sold SEK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 274 039	16 701 000	(33 111)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought GBP / Sold SEK, due 04/01/24	London	1 364 069	17 990 000	(46 249)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	2 085 740	3 519 000	(8 938)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 04/01/24	UBS AG	2 392 934	4 040 000	(12 310)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	4 489 530	7 559 000	(14 679)	(0,00)
Bought GBP / Sold THB, due 04/01/24	Merrill Lynch International	2 701 640	119 928 000	(69 813)	(0,00)
Bought GBP / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	4 100 805	180 311 000	(55 365)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought GBP / Sold THB, due 05/02/24	London	6 778 399	300 239 000	(179 143)	(0,01)
Bought HUF / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	182 311 000	450 406	(8 321)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought HUF / Sold CHF, due 04/01/24	Corporation	71 845 000	177 694	(3 515)	(0,00)
Bought HUF / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 133 541 000	2 572 915	(4 364)	(0,00)
Bought HUF / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	546 543 000	1 582 914	(3 563)	(0,00)
Bought IDR / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	22 154 566 000	1 236 166	(29 867)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought IDR / Sold CHF, due 04/01/24	London	10 960 258 000	615 607	(19 591)	(0,00)
Bought IDR / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	13 379 552 000	751 724	(24 193)	(0,00)
Bought IDR / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	151 689 719 000	8 935 540	(19 218)	(0,00)
Bought ILS / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	2 627 000	618 669	(5 520)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought ILS / Sold CHF, due 04/01/24	Corporation	898 000	210 310	(494)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	656 273 000	3 932 697	(17 525)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	2 752 411 000	16 470 368	(45 727)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought JPY / Sold CHF, due 04/01/24	Corporation	35 404 000	215 798	(5 271)	(0,00)
Bought JPY / Sold CHF, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	322 173 000	1 929 369	(3 619)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought JPY / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	48 640 000	292 289	(1 742)	(0,00)
Bought KRW / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	4 995 431 000	3 308 342	(51 782)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought KRW / Sold CHF, due 04/01/24	London	2 462 247 000	1 639 029	(35 441)	(0,00)
Bought KRW / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	2 017 023 000	1 347 370	(34 630)	(0,00)
Bought KRW / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	2 836 219 000	2 006 753	(14 493)	(0,00)
Bought MXN / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	10 453 000	523 377	(4 681)	(0,00)
Bought MXN / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	25 558 000	1 285 473	(18 332)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought MXN / Sold CHF, due 04/01/24	Corporation	12 760 000	635 563	(1 765)	(0,00)
Bought MYR / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	3 163 000	591 990	(14 967)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought MYR / Sold CHF, due 04/01/24	International	9 113 000	1 691 440	(26 302)	(0,00)
Bought NOK / Sold CHF, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	5 739 000	482 365	(8 002)	(0,00)
Bought NOK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	31 022 000	2 397 786	(1 995)	(0,00)
Bought NOK / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	12 251 000	1 207 782	(1 433)	(0,00)
Bought NZD / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	412 000	221 268	(2 040)	(0,00)
Bought NZD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	965 000	520 740	(7 723)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought NZD / Sold CHF, due 04/01/24	Corporation	503 000	270 081	(2 420)	(0,00)
Bought PEN / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	145 000	33 704	(885)	(0,00)
Bought PEN / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 946 000	477 412	(1 836)	(0,00)
Bought PLN / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 942 000	421 672	(7 147)	(0,00)
Bought PLN / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 577 000	995 564	(18 920)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought PLN / Sold CHF, due 04/01/24	Corporation	2 371 000	514 937	(8 862)	(0,00)
Bought PLN / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	28 375 000	6 541 002	(9 904)	(0,00)
Bought PLN / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	36 273 000	7 258 535	(28 838)	(0,00)
Bought PLN / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	13 228 000	3 375 604	(11 664)	(0,00)
Bought RON / Sold CHF, due 04/01/24	Merrill Lynch International	1 064 000	201 699	(3 391)	(0,00)
Bought RON / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	2 198 000	417 007	(7 409)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought RON / Sold CHF, due 04/01/24	Corporation	1 194 000	226 451	(3 935)	(0,00)
Bought RON / Sold EUR, due 04/01/24	UBS AG	13 883 000	2 790 819	(351)	(0,00)
Bought RON / Sold GBP, due 04/01/24	UBS AG	17 276 000	3 013 629	(5 751)	(0,00)
Bought RON / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	8 364 000	1 861 253	(4 072)	(0,00)
Bought SEK / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	4 725 000	402 829	(9 750)	(0,00)
Bought SEK / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	24 371 000	2 202 410	(14 617)	(0,00)
Bought SEK / Sold GBP, due 04/01/24	BNP Paribas SA	34 691 000	2 720 993	(26 301)	(0,00)
Bought SEK / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	12 658 000	1 266 227	(10 156)	(0,00)
Bought SGD / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	411 000	267 659	(6 427)	(0,00)
Bought SGD / Sold CHF, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	878 000	566 333	(7 248)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought SGD / Sold CHF, due 04/01/24	Corporation	501 000	326 574	(8 194)	(0,00)
Bought THB / Sold CHF, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	19 807 000	491 462	(3 584)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought THB / Sold CHF, due 04/01/24	Corporation	41 064 000	1 016 595	(4 688)	(0,00)
Bought USD / Sold AUD, due 04/01/24	UBS AG	15 236 274	22 962 000	(432 350)	(0,01)
Bought USD / Sold CAD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	16 788 889	22 776 000	(484 530)	(0,01)
Bought USD / Sold CAD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	10 844 533	14 302 000	(7 081)	(0,00)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	75 626 668	65 398 071	(2 075 550)	(0,05)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 555 279	1 358 211	(58 469)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Goldman Sachs International	25 041 666	21 340 508	(313 895)	(0,01)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	25 041 666	21 360 541	(337 697)	(0,01)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	UBS AG	18 516 000	16 098 125	(610 864)	(0,01)
Bought USD / Sold CHF, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	23 275 000	20 277 071	(817 046)	(0,02)
Bought USD / Sold CHF, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	5 017 000	4 277 248	(81 887)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 05/02/24	BNP Paribas SA	2 113 488	1 800 819	(33 260)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	143 000	121 814	(2 214)	(0,00)
Bought USD / Sold CLP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	390 281	343 135 000	(2 635)	(0,00)
Bought USD / Sold CNY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	360 988	2 594 000	(4 803)	(0,00)
Bought USD / Sold CNY, due 04/01/24	Deutsche Bank AG	86 055 980	612 574 000	(325 811)	(0,01)
Bought USD / Sold CNY, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	2 129 644	15 198 000	(13 493)	(0,00)
Bought USD / Sold CNY, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	377 957	2 685 000	(667)	(0,00)
Bought USD / Sold CNY, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	54 410 076	387 699 000	(433 096)	(0,01)
Bought USD / Sold COP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	1 113 828	4 599 208 000	(73 139)	(0,00)
Bought USD / Sold COP, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	1 161 839	4 599 208 000	(17 439)	(0,00)
Bought USD / Sold DKK, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	1 454 613	9 857 000	(6 111)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	226 089 556	206 032 157	(1 512 605)	(0,04)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 502 287	2 306 702	(45 910)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	249 345 146	226 093 741	(418 895)	(0,01)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Merrill Lynch International	111 093 475	101 122 500	(615 781)	(0,01)
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	33 194 713	30 647 265	(661 089)	(0,01)
Bought USD / Sold EUR, due 05/02/24	Westpac Banking Corporation	1 323 000	1 209 663	(14 977)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	302 431 333	237 985 502	(954 129)	(0,02)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Citibank NA	595 882	472 000	(5 827)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	337 819 125	265 610 246	(782 539)	(0,02)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	300 169 334	236 112 117	(827 925)	(0,02)
Bought USD / Sold GBP, due 05/02/24	Goldman Sachs International	23 040 011	18 106 000	(45 674)	(0,00)
Bought USD / Sold IDR, due 04/01/24	UBS AG	6 421 141	100 312 800 000	(93 883)	(0,00)
Bought USD / Sold IDR, due 05/02/24	BNP Paribas SA	4 972 587	77 108 910 000	(33 917)	(0,00)
Bought USD / Sold ILS, due 04/01/24	UBS AG	1 623 601	5 956 000	(30 446)	(0,00)
Bought USD / Sold ILS, due 05/02/24	UBS AG	1 646 668	5 956 000	(8 417)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	79 439 960	11 658 722 500	(3 257 746)	(0,07)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	79 396 579	11 657 623 500	(3 293 331)	(0,07)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	2 184 521	319 923 000	(84 759)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	712 451	100 649 000	(1 473)	(0,00)
Bought USD / Sold JPY, due 05/02/24	BNP Paribas SA	50 760 245	7 191 077 000	(496 074)	(0,01)
Bought USD / Sold JPY, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	50 699 585	7 191 077 000	(556 734)	(0,01)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Couvertures de contrats de change à terme – (0,37) % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold KRW, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	13 938 930	18 133 851 000	(142 177)	(0,00)
Bought USD / Sold KRW, due 05/02/24	JPMorgan Chase Bank NA London	9 240 640	12 049 424 000	(132 333)	(0,00)
Bought USD / Sold MXN, due 04/01/24	BNP Paribas SA	5 244 869	90 628 000	(105 979)	(0,00)
Bought USD / Sold MXN, due 06/02/24	UBS AG	3 456 249	58 909 000	(3 512)	(0,00)
Bought USD / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	4 997 962	23 288 000	(70 479)	(0,00)
Bought USD / Sold MYR, due 05/02/24	Goldman Sachs International	4 997 962	23 288 000	(81 376)	(0,00)
Bought USD / Sold NOK, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 151 582	12 251 000	(54 767)	(0,00)
Bought USD / Sold NZD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 279 304	3 707 000	(67 782)	(0,00)
Bought USD / Sold NZD, due 05/02/24	UBS AG	2 344 674	3 707 000	(2 705)	(0,00)
Bought USD / Sold PEN, due 04/01/24	Standard Chartered Bank	497 161	1 865 000	(6 522)	(0,00)
Bought USD / Sold PEN, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	501 507	1 865 000	(1 718)	(0,00)
Bought USD / Sold PLN, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	4 390 218	17 345 000	(20 695)	(0,00)
Bought USD / Sold RON, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 847 330	8 364 000	(9 851)	(0,00)
Bought USD / Sold SEK, due 04/01/24	UBS AG	1 225 565	12 658 000	(30 508)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 747 323	3 654 000	(22 877)	(0,00)
Bought USD / Sold SGD, due 05/02/24	UBS AG	2 457 509	3 243 000	(4 649)	(0,00)
Bought USD / Sold THB, due 04/01/24	UBS AG	4 092 832	143 658 000	(116 336)	(0,00)
Bought USD / Sold THB, due 05/02/24	JPMorgan Chase Bank NA London	4 120 112	143 658 000	(100 934)	(0,00)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(67 076 684)	(1,41)
Total des contrats de change à terme – couverture				(17 729 006)	(0,37)
Autres actifs/(passifs) nets				90 315 757	1,90
TOTAL DES ACTIFS NETS				4 765 563 709	100,00

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Obligations d'État – 96,55 %				Obligations d'État – 96,55 % (<i>suite</i>)			
Brésil				Chine			
26 900 000 BRL	Brazil Letras do Tesouro Nacional, zero coupon, 01/07/24	5 269 481	0,23	9 900 000 CNY	China Development Bank, 3.340%, 14/07/25	1 417 667	0,06
313 000 000 BRL	Brazil Letras do Tesouro Nacional, zero coupon, 01/07/25	54 667 274	2,41	300 000 CNY	China Development Bank, 4.150%, 26/10/25	43 656	0,00
215 000 000 BRL	Brazil Letras do Tesouro Nacional, zero coupon, 01/07/26	35 120 739	1,54	8 900 000 CNY	China Development Bank, 3.390%, 10/07/27	1 293 071	0,06
83 780 000 BRL	Brazil Letras do Tesouro Nacional, zero coupon, 01/07/27	12 407 205	0,55	14 300 000 CNY	China Development Bank, 3.700%, 20/10/30	2 144 450	0,09
116 970 000 BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10.000%, 01/01/25	24 099 357	1,06	15 000 000 CNY	China Government Bond, 2.470%, 02/09/24	2 120 150	0,09
139 715 000 BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10.000%, 01/01/27	28 904 159	1,27	20 370 000 CNY	China Government Bond, 2.940%, 17/10/24	2 891 679	0,13
154 674 000 BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10.000%, 01/01/29	31 764 036	1,40	33 400 000 CNY	China Government Bond, 2.260%, 24/02/25	4 714 416	0,21
125 500 000 BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10.000%, 01/01/31	25 457 608	1,12	60 000 000 CNY	China Government Bond, 1.990%, 09/04/25	8 438 018	0,37
1 450 000 BRL	Brazilian Government International Bond, 8.500%, 05/01/24	298 471	0,01	17 100 000 CNY	China Government Bond, 2.240%, 25/05/25	2 413 141	0,11
500 000 BRL	Brazilian Government International Bond, 10.250%, 10/01/28	104 593	0,00	25 200 000 CNY	China Government Bond, 2.180%, 25/08/25	3 552 084	0,16
Brésil – Total		218 092 923	9,59	21 000 000 CNY	China Government Bond, 2.280%, 25/11/25	2 964 739	0,13
Chili				Chine			
5 880 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 2.500%, 01/03/25	6 457 723	0,28	18 040 000 CNY	China Government Bond, 3.220%, 06/12/25	2 595 649	0,11
4 680 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.500%, 01/03/26	5 263 173	0,23	30 000 000 CNY	China Government Bond, 2.460%, 15/02/26	4 248 943	0,19
2 725 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 2.300%, 01/10/28	2 727 824	0,12	22 800 000 CNY	China Government Bond, 3.030%, 11/03/26	3 273 031	0,14
2 465 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.000%, 01/10/28	2 783 243	0,12	25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.300%, 15/05/26	3 528 038	0,15
5 670 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.700%, 01/09/30	6 257 407	0,27	42 130 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 06/06/26	6 088 997	0,27
3 770 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 6.000%, 01/04/33	4 518 233	0,20	9 050 000 CNY	China Government Bond, 2.690%, 12/08/26	1 289 067	0,06
1 175 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 7.000%, 01/05/34	1 515 920	0,07	35 000 000 CNY	China Government Bond, 2.180%, 15/08/26	4 922 000	0,22
6 180 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.000%, 01/03/35	6 954 880	0,31	6 700 000 CNY	China Government Bond, 3.120%, 05/12/26	968 293	0,04
4 350 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 6.000%, 01/01/43	5 417 966	0,24	36 200 000 CNY	China Government Bond, 2.370%, 20/01/27	5 109 916	0,22
155 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.100%, 15/07/50	173 318	0,01	19 500 000 CNY	China Government Bond, 2.480%, 15/04/27	2 758 997	0,12
Chili – Total		42 069 687	1,85	39 900 000 CNY	China Government Bond, 2.850%, 04/06/27	5 716 881	0,25
				11 700 000 CNY	China Government Bond, 2.710%, 19/06/27	1 669 003	0,07
				27 900 000 CNY	China Government Bond, 2.500%, 25/07/27	3 951 625	0,17
				16 500 000 CNY	China Government Bond, 2.440%, 15/10/27	2 334 300	0,10
				25 300 000 CNY	China Government Bond, 3.280%, 03/12/27	3 702 717	0,16
				30 000 000 CNY	China Government Bond, 2.640%, 15/01/28	4 271 420	0,19
				30 000 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 15/04/28	4 272 362	0,19

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 96,55 % (suite)				Obligations d'État – 96,55 % (suite)			
Chine (suite)				Chine (suite)			
24 900 000 CNY	China Government Bond, 3.010%, 13/05/28	3 602 311	0,16	8 900 000 CNY	China Government Bond, 3.390%, 16/03/50	1 364 506	0,06
30 000 000 CNY	China Government Bond, 2.400%, 15/07/28	4 233 973	0,19	29 400 000 CNY	China Government Bond, 3.810%, 14/09/50	4 847 549	0,21
1 270 000 CNY	China Government Bond, 3.540%, 16/08/28	189 236	0,01	11 700 000 CNY	China Government Bond, 3.720%, 12/04/51	1 901 201	0,08
10 000 000 CNY	China Government Bond, 2.480%, 25/09/28	1 415 793	0,06	10 500 000 CNY	China Government Bond, 3.530%, 18/10/51	1 653 825	0,07
26 900 000 CNY	China Government Bond, 2.910%, 14/10/28	3 880 230	0,17	18 900 000 CNY	China Government Bond, 3.320%, 15/04/52	2 885 237	0,13
30 000 000 CNY	China Government Bond, 2.550%, 15/10/28	4 261 009	0,19	15 000 000 CNY	China Government Bond, 3.120%, 25/10/52	2 208 584	0,10
19 700 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 22/11/28	2 890 407	0,13	15 000 000 CNY	China Government Bond, 3.190%, 15/04/53	2 251 766	0,10
25 400 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 24/03/29	3 642 246	0,16	5 000 000 CNY	China Government Bond, 3.000%, 15/10/53	731 126	0,03
30 030 000 CNY	China Government Bond, 3.290%, 23/05/29	4 424 181	0,19	Chine – Total		219 663 471	9,66
24 900 000 CNY	China Government Bond, 2.750%, 15/06/29	3 560 582	0,16	Colombie			
25 200 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 25/09/29	3 579 008	0,16	1 346 000 000 COP	Colombia Government International Bond, 9.850%, 28/06/27	334 850	0,02
34 100 000 CNY	China Government Bond, 3.130%, 21/11/29	4 983 174	0,22	17 852 900 000 COP	Colombian TES, 6.250%, 26/11/25	4 372 578	0,19
25 000 000 CNY	China Government Bond, 2.790%, 15/12/29	3 580 340	0,16	48 800 600 000 COP	Colombian TES, 7.500%, 26/08/26	12 061 583	0,53
30 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 25/03/30	4 290 196	0,19	40 549 000 000 COP	Colombian TES, 5.750%, 03/11/27	9 275 505	0,41
40 400 000 CNY	China Government Bond, 2.680%, 21/05/30	5 744 101	0,25	30 969 300 000 COP	Colombian TES, 6.000%, 28/04/28	7 062 323	0,31
30 000 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 25/06/30	4 252 395	0,19	12 328 500 000 COP	Colombian TES, 7.750%, 18/09/30	2 902 257	0,13
35 000 000 CNY	China Government Bond, 2.600%, 15/09/30	4 956 184	0,22	50 916 000 000 COP	Colombian TES, 7.000%, 26/03/31	11 360 025	0,50
35 600 000 CNY	China Government Bond, 3.270%, 19/11/30	5 270 923	0,23	39 480 000 000 COP	Colombian TES, 7.000%, 30/06/32	8 544 964	0,38
19 300 000 CNY	China Government Bond, 3.020%, 27/05/31	2 807 499	0,12	36 750 000 000 COP	Colombian TES, 13.250%, 09/02/33	11 299 961	0,50
20 100 000 CNY	China Government Bond, 2.890%, 18/11/31	2 900 008	0,13	38 682 800 000 COP	Colombian TES, 7.250%, 18/10/34	8 225 537	0,36
27 100 000 CNY	China Government Bond, 2.750%, 17/02/32	3 867 329	0,17	19 646 200 000 COP	Colombian TES, 6.250%, 09/07/36	3 710 262	0,16
22 700 000 CNY	China Government Bond, 2.760%, 15/05/32	3 240 513	0,14	43 738 000 000 COP	Colombian TES, 9.250%, 28/05/42	10 290 285	0,45
31 400 000 CNY	China Government Bond, 2.690%, 15/08/32	4 460 483	0,20	39 236 300 000 COP	Colombian TES, 7.250%, 26/10/50	7 382 076	0,32
20 200 000 CNY	China Government Bond, 2.600%, 01/09/32	2 849 246	0,12	Colombie – Total		96 822 206	4,26
20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 15/11/32	2 867 729	0,13	République tchèque			
20 000 000 CNY	China Government Bond, 2.880%, 25/02/33	2 890 818	0,13	25 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.010%, 12/12/24	1 068 811	0,05
27 000 000 CNY	China Government Bond, 2.670%, 25/05/33	3 826 023	0,17	159 500 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.250%, 14/02/25	6 873 039	0,30
40 000 000 CNY	China Government Bond, 2.520%, 25/08/33	5 613 948	0,25	183 800 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.400%, 17/09/25	7 952 473	0,35
4 200 000 CNY	China Government Bond, 3.860%, 22/07/49	694 160	0,03	173 200 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 6.000%, 26/02/26	8 077 387	0,35
				146 030 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.000%, 26/06/26	6 066 855	0,27

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 96,55 % (suite)				Obligations d'État – 96,55 % (suite)				
République tchèque (suite)				Égypte (suite)				
205 730 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.250%, 10/02/27	8 225 389	0,36	32 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 16.100%, 07/05/29	504 446	0,02	
213 700 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.500%, 25/08/28	9 075 958	0,40	28 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.664%, 06/10/30	402 186	0,02	
210 900 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.500%, 12/12/28	10 238 505	0,45	Égypte – Total			7 729 587	0,34
17 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.750%, 29/03/29	833 460	0,04	Hongrie				
213 970 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.750%, 23/07/29	9 105 089	0,40	1 049 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.500%, 24/10/24	2 922 161	0,13	
111 600 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.050%, 29/11/29	4 039 643	0,18	1 319 600 000 HUF	Hungary Government Bond, 5.500%, 24/06/25	3 769 247	0,17	
191 640 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.950%, 15/05/30	7 257 026	0,32	1 878 400 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.000%, 26/11/25	4 935 634	0,22	
226 800 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.000%, 30/09/30	10 924 649	0,48	2 006 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.500%, 22/04/26	5 228 095	0,23	
214 100 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.200%, 13/03/31	8 075 786	0,35	1 426 100 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.500%, 26/08/26	3 669 750	0,16	
55 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 6.200%, 16/06/31	2 859 485	0,13	1 067 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 9.500%, 21/10/26	3 341 507	0,15	
225 300 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.750%, 23/06/32	8 690 738	0,38	1 575 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.750%, 22/12/26	4 148 002	0,18	
15 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.500%, 11/11/32	710 087	0,03	2 031 100 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 27/10/27	5 346 932	0,23	
226 560 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.000%, 13/10/33	8 722 868	0,38	1 289 400 000 HUF	Hungary Government Bond, 4.500%, 23/03/28	3 554 252	0,16	
57 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.900%, 14/04/34	2 801 377	0,12	646 200 000 HUF	Hungary Government Bond, 6.750%, 22/10/28	1 939 988	0,08	
134 300 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 3.500%, 30/05/35	5 874 183	0,26	1 759 100 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.000%, 23/05/29	4 245 083	0,19	
106 840 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.200%, 04/12/36	4 983 518	0,22	1 834 800 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 21/08/30	4 546 201	0,20	
50 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.950%, 30/07/37	1 807 661	0,08	2 216 600 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.250%, 22/10/31	5 451 339	0,24	
90 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.500%, 24/04/40	2 901 374	0,13	2 004 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 4.750%, 24/11/32	5 349 494	0,23	
République tchèque – Total			137 165 361	6,03	2 327 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.250%, 20/04/33	5 099 512	0,22
République dominicaine				Hongrie – Total				
93 000 000 DOP	Dominican Republic International Bond, 9.750%, 05/06/26	1 603 633	0,07	498 600 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.250%, 22/06/34	1 051 330	0,05	
93 000 000 DOP	Dominican Republic International Bond, 13.625%, 03/02/33	1 948 399	0,09	1 211 800 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 27/10/38	2 455 712	0,11	
République dominicaine – Total			3 552 032	0,16	861 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 25/04/41	1 683 315	0,07
Égypte				Indonésie				
98 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.522%, 04/01/25	1 731 518	0,08	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.500%, 129 167 000 000 15/06/25	8 408 061	0,37		
49 420 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.369%, 20/10/25	852 565	0,04	32 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 11.000%, 15/09/25	2 230 045	0,10	
111 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.483%, 06/04/26	1 868 964	0,08	IDR Indonesia Treasury Bond, 5.500%, 135 000 000 000 15/04/26	8 614 503	0,38		
39 250 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.285%, 11/01/27	574 694	0,02	IDR Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 105 656 000 000 15/09/26	7 208 653	0,32		
77 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.556%, 13/10/27	1 208 595	0,05	IDR Indonesia Treasury Bond, 5.125%, 110 773 000 000 15/04/27	6 957 036	0,31		
38 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.292%, 05/01/28	586 619	0,03	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 105 274 000 000 15/05/27	6 974 052	0,31		

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 96,55 % (suite)				Obligations d'État – 96,55 % (suite)				
Indonésie (suite)				Indonésie (suite)				
120 651 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.125%, 15/05/28	7 769 401	0,34	25 000 000 000	IDR Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.625%, 15/09/29	1 626 656	0,07	
116 946 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.375%, 15/08/28	7 599 173	0,33	20 000 000 000	IDR Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 8.875%, 15/11/31	1 469 702	0,06	
77 714 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 9.000%, 15/03/29	5 587 413	0,25	85 340 000 000	IDR Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.375%, 15/03/34	5 407 813	0,24	
30 000 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.875%, 15/04/29	1 982 195	0,09	50 000 000 000	IDR Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.875%, 15/03/36	3 296 780	0,14	
107 917 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 8.250%, 15/05/29	7 580 193	0,33	3 000 000 000	IDR Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.500%, 15/06/39	189 804	0,01	
198 675 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/09/30	13 251 882	0,58	Indonésie – Total			222 484 331	9,78
213 201 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.500%, 15/02/31	13 838 610	0,61	Malaisie				
59 480 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 8.750%, 15/05/31	4 349 840	0,19	12 960 000	MYR Malaysia Government Bond, 4.059%, 30/09/24	2 838 452	0,12	
214 920 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.375%, 15/04/32	13 832 936	0,61	23 300 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.882%, 14/03/25	5 100 342	0,22	
30 000 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 8.250%, 15/06/32	2 155 939	0,09	32 914 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.955%, 15/09/25	7 237 212	0,32	
55 620 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/08/32	3 830 942	0,17	787 000	MYR Malaysia Government Bond, 4.392%, 15/04/26	174 956	0,01	
133 841 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/02/33	9 027 335	0,40	29 497 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.906%, 15/07/26	6 491 523	0,29	
71 539 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.625%, 15/05/33	4 678 819	0,21	23 153 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.900%, 30/11/26	5 102 503	0,22	
40 000 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.625%, 15/02/34	2 620 545	0,11	18 700 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.502%, 31/05/27	4 062 946	0,18	
141 413 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 15/03/34	10 396 799	0,46	25 792 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.899%, 16/11/27	5 686 813	0,25	
114 615 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/06/35	8 006 003	0,35	22 500 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.519%, 20/04/28	4 887 323	0,22	
94 931 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 8.250%, 15/05/36	6 997 901	0,31	25 873 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.733%, 15/06/28	5 658 417	0,25	
53 414 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.250%, 15/06/36	3 389 328	0,15	18 500 000	MYR Malaysia Government Bond, 4.504%, 30/04/29	4 190 703	0,18	
29 209 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 6.375%, 15/07/37	1 868 602	0,08	18 037 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.885%, 15/08/29	3 968 395	0,17	
81 730 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/05/38	5 693 020	0,25	22 950 000	MYR Malaysia Government Bond, 2.632%, 15/04/31	4 638 322	0,20	
75 000 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.125%, 15/06/38	5 107 326	0,22	743 000	MYR Malaysia Government Bond, 4.232%, 30/06/31	166 269	0,01	
57 449 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 15/04/39	4 309 514	0,19	33 300 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.582%, 15/07/32	7 133 012	0,31	
106 654 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/04/40	7 422 525	0,33	16 900 000	MYR Malaysia Government Bond, 4.642%, 07/11/33	3 951 731	0,17	
101 858 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.125%, 15/06/42	6 898 080	0,30	17 340 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.828%, 05/07/34	3 759 252	0,17	
55 000 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.125%, 15/06/43	3 718 582	0,16	22 911 000	MYR Malaysia Government Bond, 4.254%, 31/05/35	5 130 468	0,23	
5 954 000 000	IDR Indonesia Treasury Bond, 7.375%, 15/05/48	408 404	0,02	33 009 000	MYR Malaysia Government Bond, 4.762%, 07/04/37	7 745 190	0,34	
55 833 000 000	IDR Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.625%, 15/10/24	3 632 496	0,16	35 500 000	MYR Malaysia Government Bond, 4.893%, 08/06/38	8 489 792	0,37	
1 500 000 000	IDR Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.125%, 15/10/25	96 513	0,00	32 500 000	MYR Malaysia Government Bond, 3.757%, 22/05/40	6 778 849	0,30	
65 000 000 000	IDR Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 4.875%, 15/07/26	4 050 910	0,18	36 500 000	MYR Malaysia Government Bond, 4.696%, 15/10/42	8 563 599	0,38	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 96,55 % (suite)				Obligations d'État – 96,55 % (suite)				
Malaisie (suite)				Mexique (suite)				
10 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.921%, 06/07/48	2 395 800	0,11	62 500 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 01/03/29	3 605 288	0,16	
34 100 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.065%, 15/06/50	7 198 477	0,32	269 613 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 31/05/29	15 613 975	0,69	
20 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.457%, 31/03/53	4 511 621	0,20	14 850 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 31/05/29	853 021	0,03	
23 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.655%, 15/10/24	5 015 702	0,22	424 034 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 29/05/31	23 411 825	1,03	
10 377 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.128%, 15/08/25	2 286 598	0,10	272 500 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 26/05/33	14 635 058	0,64	
34 400 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.990%, 15/10/25	7 569 497	0,33	113 100 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 23/11/34	6 122 674	0,27	
29 070 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.726%, 31/03/26	6 367 469	0,28	22 000 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 24/05/35	1 189 613	0,05	
40 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.070%, 30/09/26	8 832 427	0,39	73 759 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 20/11/36	4 701 268	0,21	
18 294 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.258%, 26/07/27	4 074 386	0,18	185 715 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 18/11/38	10 493 344	0,46	
37 900 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.422%, 30/09/27	8 223 063	0,36	331 165 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 13/11/42	17 282 689	0,76	
21 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.599%, 31/07/28	4 678 040	0,21	252 822 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 07/11/47	13 391 527	0,59	
23 150 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.369%, 31/10/28	5 201 017	0,23	184 300 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 31/07/53	9 706 264	0,43	
24 846 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.130%, 09/07/29	5 516 055	0,24	Mexique – Total			223 346 781	9,82
25 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.245%, 30/09/30	5 602 530	0,25	Pérou				
35 525 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.465%, 15/10/30	7 570 691	0,33	2 605 000 PEN	Peru Government Bond, 8.200%, 12/08/26	747 867	0,03	
32 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.193%, 07/10/32	7 271 548	0,32	31 527 000 PEN	Peru Government Bond, 6.350%, 12/08/28	8 712 406	0,38	
743 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.724%, 15/06/33	173 178	0,01	20 735 000 PEN	Peru Government Bond, 5.940%, 12/02/29	5 598 778	0,25	
350 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.119%, 30/11/34	77 994	0,00	26 500 000 PEN	Peru Government Bond, 6.950%, 12/08/31	7 400 468	0,33	
22 200 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.447%, 15/07/36	4 587 235	0,20	30 400 000 PEN	Peru Government Bond, 6.150%, 12/08/32	8 021 713	0,35	
21 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.662%, 31/03/38	5 034 579	0,22	16 200 000 PEN	Peru Government Bond, 7.300%, 12/08/33	4 583 726	0,20	
20 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.417%, 30/09/41	4 623 319	0,20	22 454 000 PEN	Peru Government Bond, 5.400%, 12/08/34	5 481 533	0,24	
22 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.291%, 14/08/43	4 913 708	0,22	21 962 000 PEN	Peru Government Bond, 6.900%, 12/08/37	5 971 972	0,26	
Malaisie – Total				Pérou – Total				
223 481 003				50 318 037				2,21
Mexique				Pologne				
214 394 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 05/09/24	12 431 927	0,55	45 300 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.250%, 25/10/24	11 264 951	0,50	
176 940 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 05/12/24	10 392 985	0,46	44 120 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 0.750%, 25/04/25	10 627 060	0,47	
26 928 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 05/12/24	1 581 679	0,07	64 250 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.250%, 25/07/25	15 912 955	0,70	
177 200 000 MXN	Mexican Bonos, 5.000%, 06/03/25	9 901 414	0,43	10 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, zero coupon, 25/10/25	2 328 133	0,10	
437 160 000 MXN	Mexican Bonos, 5.750%, 05/03/26	23 822 180	1,05	70 700 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/26	16 939 952	0,74	
68 500 000 MXN	Mexican Bonos, 7.000%, 03/09/26	3 804 825	0,17	46 300 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 0.250%, 25/10/26	10 349 488	0,46	
398 600 000 MXN	Mexican Bonos, 5.500%, 04/03/27	21 063 343	0,92	55 000 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.750%, 25/05/27	13 479 458	0,59	
345 044 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 03/06/27	19 341 882	0,85	41 600 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/27	9 772 945	0,43	
				49 567 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/04/28	11 560 906	0,51	
				55 800 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 7.500%, 25/07/28	15 614 209	0,69	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Obligations d'État – 96,55 % (suite)				Obligations d'État – 96,55 % (suite)					
Pologne (suite)				Roumanie (suite)					
70 300 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/10/29	15 977 037	0,70	15 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.250%, 28/04/36	2 766 653	0,12		
55 450 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.250%, 25/10/30	11 171 083	0,49	15 250 000 RON	Romania Government Bond, 7.900%, 24/02/38	3 906 720	0,17		
69 300 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.750%, 25/04/32	13 719 541	0,60	Roumanie – Total			82 585 342	3,63	
31 500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 6.000%, 25/10/33	8 494 526	0,37	Serbie					
Pologne – Total				446 700 000 RSD	Serbia Treasury Bonds, 4.500%, 11/01/26	3 931 697	0,18		
				167 212 244	7,35	217 200 000 RSD	Serbia Treasury Bonds, 5.875%, 08/02/28	2 107 366	0,09
Roumanie				Serbie – Total				6 039 063	0,27
5 800 000 RON	Romania Government Bond, 3.700%, 25/11/24	1 262 655	0,06	Afrique du Sud					
19 160 000 RON	Romania Government Bond, 4.750%, 24/02/25	4 196 706	0,18	8 050 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 10.500%, 21/12/26	460 863	0,02		
16 200 000 RON	Romania Government Bond, 3.650%, 28/07/25	3 473 543	0,15	463 132 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 10.500%, 21/12/26	26 514 328	1,17		
18 000 000 RON	Romania Government Bond, 3.500%, 25/11/25	3 821 343	0,17	512 018 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.000%, 31/01/30	25 774 609	1,13		
17 700 000 RON	Romania Government Bond, 4.850%, 22/04/26	3 829 793	0,17	4 000 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 7.000%, 28/02/31	183 309	0,01		
20 700 000 RON	Romania Government Bond, 3.250%, 24/06/26	4 305 008	0,19	248 936 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 7.000%, 28/02/31	11 408 055	0,50		
7 000 000 RON	Romania Government Bond, 7.200%, 28/10/26	1 592 719	0,07	426 464 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.250%, 31/03/32	20 379 220	0,90		
10 000 000 RON	Romania Government Bond, 7.200%, 31/05/27	2 284 139	0,10	402 093 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.875%, 28/02/35	18 567 923	0,82		
17 300 000 RON	Romania Government Bond, 5.800%, 26/07/27	3 799 097	0,17	193 680 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 6.250%, 31/03/36	6 960 566	0,31		
18 700 000 RON	Romania Government Bond, 2.500%, 25/10/27	3 649 730	0,16	391 206 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.500%, 31/01/37	16 694 966	0,73		
14 300 000 RON	Romania Government Bond, 4.150%, 26/01/28	2 954 924	0,13	350 038 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 9.000%, 31/01/40	14 931 032	0,66		
22 200 000 RON	Romania Government Bond, 8.750%, 30/10/28	5 437 733	0,24	51 855 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 6.500%, 28/02/41	1 717 548	0,07		
19 755 000 RON	Romania Government Bond, 5.000%, 12/02/29	4 159 490	0,18	80 000 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 6.500%, 28/02/41	2 649 770	0,12		
22 200 000 RON	Romania Government Bond, 4.850%, 25/07/29	4 620 564	0,20	356 167 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.750%, 31/01/44	14 447 779	0,63		
2 000 000 RON	Romania Government Bond, 8.000%, 29/04/30	483 897	0,02	9 007 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.750%, 28/02/48	362 961	0,02		
27 800 000 RON	Romania Government Bond, 4.150%, 24/10/30	5 490 803	0,24						
4 350 000 RON	Romania Government Bond, 7.350%, 28/04/31	1 024 017	0,05						
20 060 000 RON	Romania Government Bond, 3.650%, 24/09/31	3 762 876	0,17						
19 450 000 RON	Romania Government Bond, 6.700%, 25/02/32	4 430 623	0,20						
20 000 000 RON	Romania Government Bond, 8.250%, 29/09/32	5 034 106	0,22						
10 800 000 RON	Romania Government Bond, 7.200%, 30/10/33	2 570 324	0,11						
19 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.750%, 11/10/34	3 727 879	0,16						

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Obligations d'État – 96,55 % (suite)				Obligations d'État – 96,55 % (suite)					
Afrique du Sud (suite)				Thaïlande (suite)					
536 900 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.750%, 28/02/48	21 635 843	0,95	296 100 000 THB	Thailand Government Bond, 3.300%, 17/06/38	8 974 652	0,39		
63 000 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 11.625%, 31/03/53	3 299 096	0,14	253 700 000 THB	Thailand Government Bond, 2.000%, 17/06/42	6 292 124	0,28		
Afrique du Sud – Total				210 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.450%, 17/06/43	6 439 877	0,28		
				185 987 868	8,18	204 005 000 THB	Thailand Government Bond, 2.875%, 17/06/46	5 483 794	0,24
Thaïlande				22 400 000 THB	Thailand Government Bond, 1.875%, 17/06/49	478 176	0,02		
305 000 000 THB	Thailand Government Bond, 0.750%, 17/09/24	8 833 987	0,39	Thaïlande – Total					
290 909 000 THB	Thailand Government Bond, 1.450%, 17/12/24	8 457 093	0,37	218 555 466 9,61					
334 000 000 THB	Thailand Government Bond, 0.950%, 17/06/25	9 585 773	0,42	Turquie					
276 864 000 THB	Thailand Government Bond, 3.850%, 12/12/25	8 346 356	0,37	27 247 000 TRY	Turkiye Government Bond, 9.000%, 24/07/24	795 250	0,03		
423 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.350%, 17/06/26	12 383 958	0,54	12 400 000 TRY	Turkiye Government Bond, 8.000%, 12/03/25	311 952	0,01		
333 778 000 THB	Thailand Government Bond, 2.125%, 17/12/26	9 711 417	0,43	37 100 000 TRY	Turkiye Government Bond, 12.600%, 01/10/25	890 631	0,04		
200 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.250%, 17/03/27	5 829 752	0,26	47 109 000 TRY	Turkiye Government Bond, 10.600%, 11/02/26	1 098 210	0,05		
383 100 000 THB	Thailand Government Bond, 1.000%, 17/06/27	10 696 608	0,47	45 000 000 TRY	Turkiye Government Bond, 16.900%, 02/09/26	1 163 016	0,05		
15 496 000 THB	Thailand Government Bond, 3.580%, 17/12/27	474 028	0,02	11 557 000 TRY	Turkiye Government Bond, 11.000%, 24/02/27	257 092	0,01		
354 500 000 THB	Thailand Government Bond, 2.650%, 17/06/28	10 477 860	0,46	116 857 000 TRY	Turkiye Government Bond, 10.500%, 11/08/27	2 672 747	0,12		
290 600 000 THB	Thailand Government Bond, 2.875%, 17/12/28	8 684 838	0,38	25 500 000 TRY	Turkiye Government Bond, 12.400%, 08/03/28	578 486	0,03		
170 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.400%, 17/03/29	4 968 562	0,22	180 000 000 TRY	Turkiye Government Bond, 17.300%, 19/07/28	4 915 352	0,22		
269 257 000 THB	Thailand Government Bond, 4.875%, 22/06/29	8 847 123	0,39	15 300 000 TRY	Turkiye Government Bond, 11.700%, 13/11/30	333 881	0,01		
315 500 000 THB	Thailand Government Bond, 1.600%, 17/12/29	8 778 031	0,39	110 000 000 TRY	Turkiye Government Bond, 17.800%, 13/07/33	2 908 851	0,13		
272 539 000 THB	Thailand Government Bond, 3.650%, 20/06/31	8 538 118	0,37	59 000 000 TRY	Turkiye Government Bond, 26.200%, 05/10/33	2 067 617	0,09		
469 700 000 THB	Thailand Government Bond, 2.000%, 17/12/31	13 137 908	0,58	Turquie – Total					
335 459 000 THB	Thailand Government Bond, 3.775%, 25/06/32	10 681 321	0,47	17 993 085 0,79					
343 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.350%, 17/06/33	10 595 040	0,47	Uruguay					
138 200 000 THB	Thailand Government Bond, 1.600%, 17/06/35	3 607 574	0,16	48 450 000 UYU	Uruguay Government International Bond, 8.500%, 15/03/28	1 194 860	0,05		
343 900 000 THB	Thailand Government Bond, 1.585%, 17/12/35	8 915 153	0,39	72 800 000 UYU	Uruguay Government International Bond, 8.250%, 21/05/31	1 739 003	0,08		
224 251 000 THB	Thailand Government Bond, 3.400%, 17/06/36	6 928 638	0,30	40 000 000 UYU	Uruguay Government International Bond, 9.750%, 20/07/33	1 040 203	0,04		
400 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.390%, 17/06/37	12 407 705	0,55	Uruguay – Total					
				3 974 066 0,17					
				Total des obligations d'État					
				2 195 810 107 96,55					
				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé					
				2 195 810 107 96,55					
				TOTAL DES INVESTISSEMENTS					
				2 195 810 107 96,55					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés

Contrats de change à terme – 0,02 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CNY / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	20 000 000	2 808 997	11 696	0,00
Bought COP / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	10 000 000 000	2 480 423	100 385	0,00
Bought COP / Sold USD, due 06/02/24	BNP Paribas SA	9 500 000 000	2 402 217	33 200	0,00
Bought COP / Sold USD, due 06/02/24	HSBC Bank PLC	10 000 000 000	2 523 978	39 619	0,00
Bought EGP / Sold USD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	40 000 000	1 208 459	77 470	0,00
Bought EGP / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	177 000 000	5 572 171	118 067	0,01
Bought EGP / Sold USD, due 06/02/24	HSBC Bank PLC	190 000 000	4 785 894	331 136	0,02
Bought IDR / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	19 000 000 000	1 225 569	8 217	0,00
Bought MYR / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	8 000 000	1 716 554	25 026	0,00
Bought PHP / Sold USD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	50 000 000	902 267	575	0,00
Bought PHP / Sold USD, due 06/02/24	HSBC Bank PLC	50 000 000	896 242	6 381	0,00
Bought THB / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	200 000 000	5 749 211	110 773	0,01
Bought USD / Sold COP, due 06/02/24	BNP Paribas SA	5 061 123	19 500 000 000	62 109	0,00
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme				924 654	0,04

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold CNY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	2 801 591	20 000 000	(19 101)	(0,00)
Bought USD / Sold COP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	2 540 005	10 000 000 000	(40 803)	(0,00)
Bought USD / Sold EGP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	776 978	27 000 000	(91 024)	(0,00)
Bought USD / Sold EGP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	5 937 500	190 000 000	(170 664)	(0,01)
Bought USD / Sold IDR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 224 927	19 000 000 000	(8 860)	(0,00)
Bought USD / Sold IDR, due 06/02/24	BNP Paribas SA	1 504 861	23 220 000 000	(1 235)	(0,00)
Bought USD / Sold MYR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	1 718 029	8 000 000	(23 552)	(0,00)
Bought USD / Sold MYR, due 06/02/24	Barclays Bank PLC	1 907 239	8 800 000	(15 676)	(0,00)
Bought USD / Sold PHP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	896 049	50 000 000	(6 792)	(0,00)
Bought USD / Sold THB, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	5 695 555	200 000 000	(164 429)	(0,01)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme				(542 136)	(0,02)
Total des contrats de change à terme				382 518	0,02
Autres actifs/(passifs) nets				78 050 311	3,43
TOTAL DES ACTIFS NETS				2 274 242 936	100,00

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,85 %				Actions ordinaires et préférentielles – 98,85 % <i>(suite)</i>			
Argentine				Inde <i>(suite)</i>			
362	USD MercadoLibre Inc	568 897	2,16	39 237	INR Infosys Ltd	727 509	2,76
Argentine – Total				3 586	INR Maruti Suzuki India Ltd	443 968	1,68
Brésil				26 128	INR Reliance Industries Ltd	811 639	3,08
119 300	BRL B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	357 340	1,35	4 266	INR Titan Co Ltd	188 424	0,71
45 200	BRL Itau Unibanco Holding SA–Preferred Stock	316 091	1,20	Inde – Total			
44 300	BRL Petroleo Brasileiro SA–Preferred Stock	339 619	1,29	Indonésie			
107 900	BRL Sendas Distribuidora S/A	300 537	1,14	639 000	IDR Bank Central Asia Tbk PT	390 115	1,48
10 000	BRL Vale SA	158 926	0,60	1 046 600	IDR Bank Mandiri Persero Tbk PT	411 244	1,56
Brésil – Total				Indonésie – Total			
Chine				Corée			
6 247	CNY 3peak Inc	128 351	0,49	352	KRW Korea Zinc Co Ltd	136 110	0,52
22 328	HKD Alibaba Group Holding Ltd	216 173	0,82	522	KRW LG Chem Ltd	202 250	0,77
40 100	HKD ANTA Sports Products Ltd	389 006	1,47	1 630	KRW Naver Corp	283 500	1,07
16 424	HKD Baidu Inc	244 197	0,93	18 253	KRW Samsung Electronics Co Ltd	1 112 556	4,22
887	USD Baidu Inc–ADR	105 633	0,40	16 701	KRW Samsung Electronics Co Ltd–Preferred Stock	807 883	3,06
5 198	HKD BYD Co Ltd	142 722	0,54	9 508	KRW Shinhan Financial Group Co Ltd	296 410	1,12
489 000	HKD China Construction Bank Corp	291 200	1,10	4 665	KRW SK Hynix Inc	512 538	1,94
57 500	HKD China Merchants Bank Co Ltd	200 293	0,76	Corée – Total			
6 900	CNY GigaDevice Semiconductor Inc	89 528	0,34	Mexique			
21 500	HKD Innovent Biologics Inc	117 708	0,45	318 800	MXN America Movil SAB de CV	296 313	1,12
33 610	HKD JD.com Inc	484 229	1,83	14 670	MXN Gruma SAB de CV	269 534	1,02
1 726	USD JD.com Inc–ADR	49 864	0,19	51 700	MXN Grupo Financiero Banorte SAB de CV	521 320	1,98
1 800	CNY Kweichow Moutai Co Ltd	436 312	1,65	Mexique – Total			
20 100	CNY Midea Group Co Ltd	154 209	0,58	Pays-Bas			
13 935	HKD NetEase Inc	250 912	0,95	6 649	ZAR Prosus NV	203 747	0,77
2 266	USD PDD Holdings Inc–ADR	331 539	1,26	Pays-Bas – Total			
36 000	HKD Ping An Insurance Group Co of China Ltd	162 975	0,62	Portugal			
9 750	CNY SG Micro Corp	121 878	0,46	9 988	EUR Jeronimo Martins SGPS SA	254 206	0,96
21 800	CNY Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	193 306	0,73	Portugal – Total			
9 800	CNY Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	399 949	1,52	Russie			
18 236	TWD Silergy Corp	297 095	1,13	3 479	USD Yandex NV*	0	0,00
30 900	HKD Tencent Holdings Ltd	1 161 834	4,40	Russie – Total			
24 000	HKD WuXi AppTec Co Ltd	244 194	0,93	Arabie saoudite			
Chine – Total				3 954	SAR Arabian Internet & Communications Services Co	365 033	1,38
Hong Kong				52 622	SAR Saudi National Bank	543 059	2,06
27 400	HKD AIA Group Ltd	238 786	0,91	26 872	SAR Saudi Telecom Co	289 860	1,10
Hong-Kong – Total				Arabie saoudite – Total			
Hongrie				Afrique du Sud			
8 375	HUF OTP Bank Nyrt	382 436	1,45	104 526	ZAR FirstRand Ltd	420 162	1,60
15 206	HUF Richter Gedeon Nyrt	384 539	1,46	18 978	ZAR Shoprite Holdings Ltd	285 435	1,08
Hongrie – Total				Afrique du Sud – Total			
Inde				Taiwan			
6 597	INR Divi's Laboratories Ltd	309 492	1,17	765	TWD ASPEED Technology Inc	77 770	0,29
15 350	INR HCL Technologies Ltd	270 444	1,03	CTBC Financial Holding Co			
25 734	INR HDFC Bank Ltd	528 589	2,00	228 000	TWD Ltd	210 613	0,80
6 878	INR Hindustan Unilever Ltd	220 188	0,84	6 924	TWD eMemory Technology Inc	552 738	2,10
33 469	USD ICICI Bank Ltd–ADR	797 901	3,02	18 208	TWD MediaTek Inc	602 177	2,28

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Autres valeurs mobilières (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,85 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 % (suite)			
Taïwan (suite)				Îles Caïmans			
126 120 TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2 436 883	9,24	1 614 600 HKD	China Metal Recycling Holdings Ltd*	0	0,00
3 225 TWD	Voltronic Power Technology Corp	179 689	0,68	Îles Caïmans – Total			
Taïwan – Total				0			
4 059 870				0,00			
Thaïlande				Mexique			
83 400 THB	Kasikornbank PCL	329 862	1,25	414 414 MXN	Corporacion Chihuahua SA de CV*	0	0,00
Thaïlande – Total				429 MXN	Corporacion Chihuahua SA de CV–Preferred Stock*	0	0,00
329 862				Mexique – Total			
1,25				0			
Émirats arabes unis				Thaïlande			
97 090 AED	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	242 675	0,92	16 900 THB	General Finance & Securities PCL*	0	0,00
Émirats arabes unis – Total				54 800 THB	Nava Finance PCL*	0	0,00
242 675				13 200 THB	Union Asia Finance PLC*	0	0,00
0,92				Thaïlande – Total			
États-Unis				0			
3 318 USD	Southern Copper Corp	285 580	1,08	0			
États-Unis – Total				0,00			
285 580				0,00			
1,08				Total des actions ordinaires et préférentielles			
26 077 694				0			
98,85				0,00			
Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Total des autres valeurs mobilières			
26 077 694				0			
98,85				0,00			
				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
				26 077 694			
				98,85			

Autres valeurs mobilières

Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 %

Brésil

587 050 BRL	Mesbla*	0	0,00
295 635 BRL	Mesbla SA*	0	0,00
Brésil – Total		0	0,00

Produits dérivés

Contrats à terme standardisés – (0,06) %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Moins-values latentes	% des actifs nets
MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	(8)	413 480	(15 556)	(0,06)
Moins-values latentes sur contrats à terme standardisés			413 480	(15 556)	(0,06)
Total des contrats à terme standardisés			413 480	(15 556)	(0,06)
Autres actifs/(passifs) nets				320 025	1,21
TOTAL DES ACTIFS NETS				26 382 163	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 27 646 USD détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

* Le Conseil d'administration a décidé de fixer le prix du titre à 0,00 conformément aux procédures d'évaluation des investissements en vigueur.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Actions ordinaires et préférentielles – 97,23 %				Actions ordinaires et préférentielles – 97,23 % (<i>suite</i>)			
France				États-Unis (<i>suite</i>)			
112 829 EUR	Dassault Systemes SE	5 513 299	2,79	21 040 USD	Visa Inc	5 477 764	2,77
19 457 EUR	EssilorLuxottica SA	3 903 161	1,98	47 012 USD	Xylem Inc	5 376 292	2,72
7 115 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	5 765 792	2,92	États-Unis – Total			
France – Total				111 824 902 56,63			
15 182 252 7,69				191 972 974 97,23			
Allemagne				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
162 977 EUR	Infineon Technologies AG	6 805 231	3,45	191 972 974 97,23			
Allemagne – Total				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
6 805 231 3,45				191 972 974 97,23			
Hong Kong				Autres actifs/(passifs) nets			
377 200 HKD	AIA Group Ltd	3 287 225	1,66	5 470 626 2,77			
Hong-Kong – Total				TOTAL DES ACTIFS NETS			
3 287 225 1,66				197 443 600 100,00			
Irlande							
24 258 USD	Trane Technologies PLC	5 916 526	3,00				
Irlande – Total							
5 916 526 3,00							
Japon							
30 100 JPY	Disco Corp	7 468 421	3,78				
32 900 JPY	Hoya Corp	4 113 084	2,09				
260 700 JPY	Murata Manufacturing Co Ltd	5 534 651	2,80				
Japon – Total							
17 116 156 8,67							
Suisse							
16 452 CHF	Roche Holding AG	4 779 319	2,42				
13 590 CHF	Sika AG	4 419 394	2,24				
Suisse – Total							
9 198 713 4,66							
Royaume-Uni							
89 116 GBP	Ashtead Group PLC	6 205 108	3,14				
14 719 USD	Linde PLC	6 045 240	3,06				
54 069 GBP	London Stock Exchange Group PLC	6 392 303	3,24				
29 864 GBP	Spirax-Sarco Engineering PLC	3 999 318	2,03				
Royaume-Uni – Total							
22 641 969 11,47							
États-Unis							
40 654 USD	Advanced Micro Devices Inc	5 992 806	3,03				
85 730 USD	Alphabet Inc	11 975 624	6,06				
65 959 USD	Amazon.com Inc	10 021 810	5,08				
56 311 USD	Amphenol Corp	5 582 109	2,83				
48 227 USD	Applied Materials Inc	7 816 150	3,96				
39 348 USD	CME Group Inc	8 286 689	4,20				
24 716 USD	Eaton Corp PLC	5 952 107	3,01				
12 182 USD	Martin Marietta Materials Inc	6 077 722	3,08				
68 095 USD	Merck & Co Inc	7 423 717	3,76				
15 931 USD	Parker-Hannifin Corp	7 339 412	3,72				
23 677 USD	Salesforce Inc	6 230 366	3,16				
8 703 USD	ServiceNow Inc	6 148 583	3,11				
35 006 USD	Splunk Inc	5 333 164	2,70				
16 689 USD	Vertex Pharmaceuticals Inc	6 790 587	3,44				

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 %				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
Australie				Canada (suite)			
250 000 USD	Commonwealth Bank of Australia, 5.079%, 10/01/25	250 370	0,09	100 000 USD	Bank of Nova Scotia, 2.150%, 01/08/31	83 116	0,03
150 000 USD	Commonwealth Bank of Australia, 5.316%, 13/03/26	152 093	0,06	280 000 USD	Bank of Nova Scotia, 2.450%, 02/02/32	234 903	0,09
250 000 USD	National Australia Bank Ltd, 4.966%, 12/01/26	251 585	0,09	200 000 USD	Bank of Nova Scotia, 4.588%, 04/05/37	179 068	0,07
130 000 USD	National Australia Bank Ltd, 3.375%, 14/01/26	126 686	0,05	140 000 USD	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada, 4.464%, 01/04/48	125 860	0,05
150 000 USD	National Australia Bank Ltd, 3.905%, 09/06/27	146 792	0,05	10 000 USD	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada, 4.300%, 29/07/49	8 604	0,00
30 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.350%, 19/02/25	29 184	0,01	330 000 USD	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada, 3.200%, 15/02/52	234 330	0,09
100 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.850%, 13/05/26	96 078	0,04	20 000 USD	Brookfield Finance Inc, 4.250%, 02/06/26	19 545	0,01
100 000 USD	Westpac Banking Corp, 1.150%, 03/06/26	92 153	0,03	300 000 USD	Brookfield Finance Inc, 4.850%, 29/03/29	298 689	0,11
170 000 USD	Westpac Banking Corp, 3.350%, 08/03/27	163 870	0,06	125 000 USD	Brookfield Finance Inc, 4.350%, 15/04/30	120 648	0,04
100 000 USD	Westpac Banking Corp, 5.457%, 18/11/27	103 380	0,04	30 000 USD	Brookfield Finance Inc, 2.724%, 15/04/31	25 452	0,01
150 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.894%, 04/02/30	144 552	0,05	110 000 USD	Brookfield Finance Inc, 4.700%, 20/09/47	96 418	0,04
110 000 USD	Westpac Banking Corp, 4.322%, 23/11/31	105 812	0,04	40 000 USD	Brookfield Finance Inc, 3.625%, 15/02/52	28 847	0,01
20 000 USD	Westpac Banking Corp, 4.110%, 24/07/34	18 320	0,01	345 000 USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 2.250%, 28/01/25	334 198	0,12
115 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.668%, 15/11/35	93 602	0,03	80 000 USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 1.250%, 22/06/26	73 348	0,03
100 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.963%, 16/11/40	69 042	0,03	100 000 USD	Canadian National Railway Co, 3.850%, 05/08/32	95 228	0,03
100 000 USD	Westpac Banking Corp, 2.150%, perpetual	84 546	0,03	15 000 USD	Canadian National Railway Co, 6.250%, 01/08/34	16 914	0,01
Australie – Total		1 928 065	0,71	250 000 USD	Canadian National Railway Co, 4.450%, 20/01/49	232 560	0,09
Bermudes				560 000 USD	Canadian National Railway Co, 2.450%, 01/05/50	368 435	0,14
470 000 USD	RenaissanceRe Holdings Ltd, 5.750%, 05/06/33	475 574	0,18	100 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 2.900%, 01/02/25	97 401	0,04
Bermudes – Total		475 574	0,18	100 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 1.750%, 02/12/26	92 315	0,03
Canada				240 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 2.875%, 15/11/29	216 310	0,08
300 000 USD	Bank of Montreal, 5.300%, 05/06/26	303 006	0,11	100 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 2.050%, 05/03/30	85 815	0,03
40 000 USD	Bank of Montreal, 1.250%, 15/09/26	36 458	0,01	200 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 2.450%, 02/12/31	185 688	0,07
210 000 USD	Bank of Montreal, 0.949%, 22/01/27	193 771	0,07	100 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 4.800%, 15/09/35	98 120	0,04
115 000 USD	Bank of Montreal, 3.803%, 15/12/32	105 854	0,04	50 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 5.950%, 15/05/37	53 546	0,02
105 000 USD	Bank of Nova Scotia, 2.200%, 03/02/25	101 817	0,04	100 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 3.000%, 02/12/41	89 503	0,03
300 000 USD	Bank of Nova Scotia, 1.300%, 11/06/25	284 286	0,10	50 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 4.300%, 15/05/43	44 061	0,02
190 000 USD	Bank of Nova Scotia, 4.500%, 16/12/25	186 954	0,07	225 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 4.800%, 01/08/45	212 377	0,08
30 000 USD	Bank of Nova Scotia, 2.700%, 03/08/26	28 436	0,01	70 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 4.700%, 01/05/48	63 875	0,02
150 000 USD	Bank of Nova Scotia, 1.300%, 15/09/26	136 697	0,05				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				
Canada (suite)				Canada (suite)				
270 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 3.100%, 02/12/51	195 953	0,07	220 000 USD	Waste Connections Inc, 2.600%, 01/02/30	197 791	0,07	
30 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 4.200%, 15/11/69	25 023	0,01	100 000 USD	Waste Connections Inc, 4.200%, 15/01/33	97 282	0,04	
169 000 USD	Canadian Pacific Railway Co, 6.125%, 15/09/15	188 667	0,07	100 000 USD	Waste Connections Inc, 2.950%, 15/01/52	70 756	0,03	
200 000 USD	CGI Inc, 2.300%, 14/09/31	163 568	0,06	Canada – Total			10 433 740	3,86
290 000 USD	Enbridge Inc, 2.500%, 15/01/25	281 352	0,10	Îles Caïmans				
15 000 USD	Enbridge Inc, 3.700%, 15/07/27	14 495	0,00	200 000 USD	Alibaba Group Holding Ltd, 3.400%, 06/12/27	189 758	0,07	
350 000 USD	Enbridge Inc, 4.500%, 10/06/44	301 423	0,11	470 000 USD	Alibaba Group Holding Ltd, 4.500%, 28/11/34	442 082	0,16	
170 000 USD	Enbridge Inc, 5.500%, 01/12/46	168 220	0,06	220 000 USD	Alibaba Group Holding Ltd, 4.000%, 06/12/37	189 919	0,07	
10 000 USD	Enbridge Inc, 4.000%, 15/11/49	7 995	0,00	100 000 USD	Alibaba Group Holding Ltd, 2.700%, 09/02/41	68 607	0,03	
80 000 USD	Enbridge Inc, 3.400%, 01/08/51	58 417	0,02	10 000 USD	Alibaba Group Holding Ltd, 4.400%, 06/12/57	8 145	0,00	
50 000 USD	Magna International Inc, 2.450%, 15/06/30	43 832	0,02	Îles Caïmans – Total			898 511	0,33
100 000 USD	Manulife Financial Corp, 4.061%, 24/02/32	94 092	0,03	France				
50 000 USD	Manulife Financial Corp, 5.375%, 04/03/46	51 053	0,02	10 000 USD	AXA SA, 8.600%, 15/12/30	12 037	0,00	
275 000 USD	Rogers Communications Inc, 3.625%, 15/12/25	267 069	0,10	50 000 USD	Legrand France SA, 8.500%, 15/02/25	51 922	0,02	
20 000 USD	Rogers Communications Inc, 2.900%, 15/11/26	18 999	0,01	115 000 USD	Orange SA, 9.000%, 01/03/31	142 174	0,05	
290 000 USD	Rogers Communications Inc, 3.200%, 15/03/27	276 843	0,10	105 000 USD	Orange SA, 5.375%, 13/01/42	107 091	0,04	
220 000 USD	Rogers Communications Inc, 5.000%, 15/03/44	206 404	0,08	50 000 USD	Orange SA, 5.500%, 06/02/44	52 100	0,02	
10 000 USD	Rogers Communications Inc, 3.700%, 15/11/49	7 607	0,00	100 000 USD	Sanofi SA, 3.625%, 19/06/28	98 033	0,04	
400 000 USD	Royal Bank of Canada, 1.150%, 10/06/25	379 360	0,14	France – Total			463 357	0,17
120 000 USD	Royal Bank of Canada, 4.650%, 27/01/26	119 101	0,04	Allemagne				
30 000 USD	Royal Bank of Canada, 1.150%, 14/07/26	27 454	0,01	300 000 USD	Deutsche Bank AG, 1.686%, 19/03/26	279 345	0,10	
150 000 USD	Royal Bank of Canada, 2.300%, 03/11/31	126 792	0,05	480 000 USD	Deutsche Bank AG, 7.146%, 13/07/27	498 705	0,19	
250 000 USD	Royal Bank of Canada, 3.875%, 04/05/32	235 902	0,09	380 000 USD	Deutsche Bank AG, 5.882%, perpetual	371 112	0,14	
70 000 USD	Royal Bank of Canada, 5.000%, 01/02/33	71 323	0,03	Allemagne – Total			1 149 162	0,43
190 000 USD	Telus Corp, 4.600%, 16/11/48	169 976	0,06	Guernesey				
20 000 USD	Thomson Reuters Corp, 3.350%, 15/05/26	19 253	0,01	275 000 USD	Amdocs Ltd, 2.538%, 15/06/30	237 331	0,09	
125 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 1.150%, 12/06/25	118 360	0,04	Guernesey – Total			237 331	0,09
370 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 0.750%, 11/09/25	345 336	0,13	Irlande				
150 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 1.250%, 10/09/26	137 088	0,05	350 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2.450%, 29/10/26	324 229	0,12	
270 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 2.000%, 10/09/31	224 891	0,08	360 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 6.450%, 15/04/27	372 899	0,14	
450 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 3.625%, 15/09/31	432 319	0,16	250 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3.000%, 29/10/28	228 015	0,08	
100 000 USD	Toronto-Dominion Bank, 4.456%, 08/06/32	97 291	0,04	250 000 USD	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3.300%, 30/01/32	217 937	0,08	
				225 000 USD	Allegion plc, 3.500%, 01/10/29	208 211	0,08	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
Irlande (suite)				Japon (suite)			
100 000 USD	GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 3.373%, 15/11/25	97 023	0,03	20 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 2.260%, 09/07/32	16 319	0,01
30 000 USD	Johnson Controls International plc, 3.900%, 14/02/26	29 322	0,01	100 000 USD	Nomura Holdings Inc, 1.851%, 16/07/25	94 613	0,04
90 000 USD	Johnson Controls International plc, 4.500%, 15/02/47	80 572	0,03	200 000 USD	Nomura Holdings Inc, 5.709%, 09/01/26	201 438	0,07
350 000 USD	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 1.750%, 15/09/30	290 794	0,11	100 000 USD	Nomura Holdings Inc, 2.329%, 22/01/27	91 773	0,03
185 000 USD	STERIS Irish FinCo UnLtd Co, 2.700%, 15/03/31	159 357	0,06	100 000 USD	Nomura Holdings Inc, 2.172%, 14/07/28	87 751	0,03
Irlande – Total		2 008 359	0,74	15 000 USD	Nomura Holdings Inc, 3.103%, 16/01/30	13 279	0,00
Ile de Man				425 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1.474%, 08/07/25	402 271	0,15
520 000 USD	AngloGold Ashanti Holdings PLC, 3.375%, 01/11/28	468 198	0,17	160 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.784%, 09/03/26	156 085	0,06
Ile de Man – Total		468 198	0,17	150 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.632%, 14/07/26	142 164	0,05
Japon				300 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1.402%, 17/09/26	273 378	0,10
100 000 USD	Honda Motor Co Ltd, 2.271%, 10/03/25	96 956	0,04	30 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.010%, 19/10/26	28 544	0,01
40 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2.193%, 25/02/25	38 642	0,01	40 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.364%, 12/07/27	38 090	0,01
100 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3.777%, 02/03/25	98 336	0,04	45 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 4.306%, 16/10/28	43 919	0,02
200 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 1.412%, 17/07/25	188 890	0,07	200 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.472%, 14/01/29	178 232	0,07
20 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3.850%, 01/03/26	19 535	0,01	530 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 3.040%, 16/07/29	482 480	0,18
120 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3.677%, 22/02/27	116 408	0,04	15 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.750%, 15/01/30	13 283	0,01
200 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 1.538%, 20/07/27	182 824	0,07	50 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.130%, 08/07/30	42 131	0,02
130 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3.961%, 02/03/28	126 727	0,05	110 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.142%, 23/09/30	91 504	0,03
120 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3.741%, 07/03/29	114 672	0,04	20 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2.296%, 12/01/41	13 863	0,01
450 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 5.242%, 19/04/29	456 183	0,17	100 000 USD	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 6.184%, 13/07/43	111 507	0,04
510 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3.195%, 18/07/29	469 455	0,17	380 000 USD	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 5.000%, 26/11/28	386 015	0,14
260 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2.309%, 20/07/32	216 115	0,08	120 000 USD	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 3.375%, 09/07/60	84 498	0,03
150 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2.852%, 19/01/33	128 586	0,05	Japon – Total		6 059 864	2,24
70 000 USD	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4.153%, 07/03/39	64 499	0,02	Jersey			
150 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 2.651%, 22/05/26	144 188	0,05	50 000 USD	Aptiv PLC, 4.350%, 15/03/29	48 836	0,02
50 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 3.663%, 28/02/27	48 121	0,02	30 000 USD	Aptiv PLC, 5.400%, 15/03/49	28 041	0,01
200 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 4.254%, 11/09/29	193 396	0,07	100 000 USD	Aptiv PLC, 3.100%, 01/12/51	65 440	0,02
10 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 2.591%, 25/05/31	8 570	0,00	Jersey – Total		142 317	0,05
425 000 USD	Mizuho Financial Group Inc, 2.201%, 10/07/31	354 624	0,13				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				
Lituanie				Singapour				
25 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC, 5.350%, 01/03/26	25 123	0,01	100 000 USD	Flex Ltd, 3.750%, 01/02/26	96 870	0,04	
210 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC, 5.550%, 01/12/28	215 872	0,08	360 000 USD	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4.650%, 19/05/30	362 901	0,13	
300 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 4.300%, 18/06/29	291 705	0,11	980 000 USD	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4.750%, 19/05/33	982 999	0,36	
150 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3.400%, 01/05/30	137 981	0,05	100 000 USD	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5.110%, 19/05/43	99 936	0,04	
100 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2.500%, 11/05/31	85 001	0,03	Singapour – Total			1 542 706	0,57
150 000 USD	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 5.000%, 15/01/33	149 968	0,06	Espagne				
Lituanie – Total				250 000 USD	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.125%, 18/09/25	233 205	0,09	
		905 650	0,34	320 000 USD	Banco Santander SA, 2.746%, 28/05/25	308 902	0,12	
Luxembourg				200 000 USD	Banco Santander SA, 5.179%, 19/11/25	198 284	0,07	
90 000 USD	DH Europe Finance II Sarl, 2.600%, 15/11/29	81 511	0,03	100 000 USD	Banco Santander SA, 1.849%, 25/03/26	92 640	0,03	
290 000 USD	DH Europe Finance II Sarl, 3.400%, 15/11/49	229 642	0,08	200 000 USD	Banco Santander SA, 4.250%, 11/04/27	193 862	0,07	
50 000 USD	Trane Technologies Financing Ltd, 3.500%, 21/03/26	48 631	0,02	20 000 USD	Banco Santander SA, 3.800%, 23/02/28	18 894	0,01	
50 000 USD	Trane Technologies Financing Ltd, 3.800%, 21/03/29	48 457	0,02	600 000 USD	Banco Santander SA, 4.175%, 24/03/28	577 152	0,21	
20 000 USD	Trane Technologies Financing Ltd, 4.500%, 21/03/49	18 570	0,01	110 000 USD	Banco Santander SA, 3.306%, 27/06/29	101 541	0,04	
Luxembourg – Total				100 000 USD	Banco Santander SA, 2.749%, 03/12/30	83 029	0,03	
		426 811	0,16	30 000 USD	Banco Santander SA, 2.958%, perpetual	25 817	0,01	
Mexique				100 000 USD	Banco Santander SA, 3.225%, perpetual	83 549	0,03	
200 000 USD	America Movil SAB de CV, 3.625%, 22/04/29	189 220	0,07	120 000 USD	Telefonica Emisiones SA, 4.103%, 08/03/27	117 637	0,04	
80 000 USD	America Movil SAB de CV, 6.125%, 30/03/40	87 120	0,03	20 000 USD	Telefonica Emisiones SA, 7.045%, 20/06/36	22 660	0,01	
100 000 USD	America Movil SAB de CV, 4.375%, 22/04/49	88 924	0,03	170 000 USD	Telefonica Emisiones SA, 4.665%, 06/03/38	156 281	0,06	
200 000 USD	Coca-Cola Femsa SAB de CV, 1.850%, 01/09/32	159 290	0,06	30 000 USD	Telefonica Emisiones SA, 5.213%, 08/03/47	27 874	0,01	
150 000 USD	Fomento Economico Mexicano SAB de CV, 4.375%, 10/05/43	132 551	0,05	110 000 USD	Telefonica Emisiones SA, 4.895%, 06/03/48	97 265	0,04	
Mexique – Total				200 000 USD	Telefonica Emisiones SA, 5.520%, 01/03/49	193 688	0,07	
		657 105	0,24	Espagne – Total			2 532 280	0,94
Pays-Bas				Royaume-Uni				
205 000 USD	Deutsche Telekom International Finance BV, 8.750%, 15/06/30	247 203	0,09	160 000 USD	Aon Global Ltd, 3.875%, 15/12/25	156 714	0,06	
70 000 USD	Iberdrola International BV, 6.750%, 15/07/36	81 477	0,03	10 000 USD	Aon Global Ltd, 4.600%, 14/06/44	8 992	0,00	
40 000 USD	ING Groep NV, 3.950%, 29/03/27	38 758	0,01	80 000 USD	AstraZeneca PLC, 3.375%, 16/11/25	78 259	0,03	
100 000 USD	ING Groep NV, 4.550%, 02/10/28	98 824	0,04	80 000 USD	AstraZeneca PLC, 4.000%, 17/01/29	79 044	0,03	
350 000 USD	ING Groep NV, 2.727%, 01/04/32	300 765	0,11	200 000 USD	AstraZeneca PLC, 1.375%, 06/08/30	166 440	0,06	
50 000 USD	Suzano International Finance BV, 5.500%, 17/01/27	50 627	0,02	200 000 USD	AstraZeneca PLC, 6.450%, 15/09/37	234 298	0,09	
30 000 USD	Utah Acquisition Sub Inc, 3.950%, 15/06/26	29 049	0,01	Pays-Bas – Total				
Pays-Bas – Total						846 703	0,31	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
50 000 USD	AstraZeneca PLC, 4.000%, 18/09/42	45 557	0,02	470 000 USD	HSBC Holdings PLC, 8.113%, 03/11/33	541 459	0,20
50 000 USD	AstraZeneca PLC, 4.375%, 16/11/45	47 105	0,02	200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.547%, 20/06/34	209 466	0,08
40 000 USD	AstraZeneca PLC, 4.375%, 17/08/48	37 706	0,01	270 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.500%, 02/05/36	281 340	0,10
90 000 USD	AstraZeneca PLC, 2.125%, 06/08/50	57 837	0,02	20 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.500%, 15/09/37	21 003	0,01
20 000 USD	Barclays PLC, 3.811%, 10/03/42	15 082	0,00	20 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.800%, 01/06/38	21 454	0,01
20 000 USD	Barclays PLC, 3.650%, 16/03/25	19 558	0,01	30 000 USD	HSBC Holdings PLC, 6.100%, 14/01/42	34 180	0,01
450 000 USD	Barclays PLC, 4.375%, 12/01/26	443 466	0,16	360 000 USD	HSBC Holdings PLC, 5.250%, 14/03/44	351 922	0,13
100 000 USD	Barclays PLC, 2.852%, 07/05/26	96 544	0,04	160 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 4.582%, 10/12/25	156 640	0,06
320 000 USD	Barclays PLC, 4.972%, 16/05/29	314 666	0,12	500 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 3.511%, 18/03/26	488 215	0,18
510 000 USD	Barclays PLC, 5.746%, 09/08/33	516 038	0,19	50 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 4.650%, 24/03/26	49 166	0,02
150 000 USD	Barclays PLC, 6.224%, 09/05/34	155 703	0,06	200 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 4.375%, 22/03/28	195 748	0,07
100 000 USD	Barclays PLC, 5.250%, 17/08/45	98 265	0,04	30 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 3.574%, 07/11/28	28 246	0,01
30 000 USD	Barclays PLC, 4.950%, 10/01/47	28 161	0,01	20 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 5.300%, 01/12/45	19 205	0,01
100 000 USD	Barclays PLC, 3.330%, perpetual	74 201	0,03	100 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 3.369%, 14/12/46	69 661	0,03
140 000 USD	British Telecommunications PLC, 9.625%, 15/12/30	173 487	0,06	50 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 4.344%, 09/01/48	40 302	0,01
50 000 USD	Brookfield Finance I UK Plc / Brookfield Finance Inc, 2.340%, 30/01/32	40 056	0,01	200 000 USD	Lloyds Banking Group PLC, 1.627%, perpetual	183 362	0,07
220 000 USD	Diageo Capital PLC, 2.375%, 24/10/29	198 205	0,07	100 000 USD	National Grid PLC, 5.602%, 12/06/28	103 159	0,04
300 000 USD	Diageo Capital PLC, 2.000%, 29/04/30	259 800	0,10	100 000 USD	National Grid PLC, 5.809%, 12/06/33	105 324	0,04
20 000 USD	Diageo Capital PLC, 5.875%, 30/09/36	22 094	0,01	200 000 USD	NatWest Group PLC, 4.800%, 05/04/26	198 388	0,07
50 000 USD	GlaxoSmithKline Capital PLC, 3.375%, 01/06/29	48 224	0,02	200 000 USD	NatWest Group PLC, 3.073%, 22/05/28	185 974	0,07
10 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.250%, 18/08/25	9 787	0,00	300 000 USD	NatWest Group PLC, 5.076%, 27/01/30	296 121	0,11
420 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.300%, 08/03/26	413 204	0,15	10 000 USD	Prudential Funding Asia PLC, 3.125%, 14/04/30	9 042	0,00
20 000 USD	HSBC Holdings PLC, 1.645%, 18/04/26	19 008	0,01	350 000 USD	Santander UK Group Holdings PLC, 1.532%, 21/08/26	326 571	0,12
240 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.292%, 12/09/26	235 006	0,09	20 000 USD	Santander UK Group Holdings PLC, 3.823%, 03/11/28	18 816	0,01
30 000 USD	HSBC Holdings PLC, 1.589%, 24/05/27	27 487	0,01	200 000 USD	Vodafone Group PLC, 4.375%, 30/05/28	199 878	0,07
100 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.251%, 22/11/27	91 838	0,03	100 000 USD	Vodafone Group PLC, 6.150%, 27/02/37	108 463	0,04
200 000 USD	HSBC Holdings PLC, 7.390%, 03/11/28	214 456	0,08	250 000 USD	Vodafone Group PLC, 5.250%, 30/05/48	244 040	0,09
405 000 USD	HSBC Holdings PLC, 4.583%, 19/06/29	393 255	0,14	150 000 USD	Vodafone Group PLC, 4.250%, 17/09/50	124 849	0,05
445 000 USD	HSBC Holdings PLC, 3.973%, 22/05/30	416 039	0,15				
250 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.357%, 18/08/31	207 722	0,08				
150 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.804%, 24/05/32	125 322	0,05				
250 000 USD	HSBC Holdings PLC, 2.871%, 22/11/32	208 305	0,08				
400 000 USD	HSBC Holdings PLC, 5.402%, 11/08/33	402 428	0,15				
				Royaume-Uni – Total		10 791 353	4,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis				États-Unis (suite)			
150 000 USD	Abbott Laboratories, 2.950%, 15/03/25	146 934	0,05	10 000 USD	Allstate Corp, 3.850%, 10/08/49	8 103	0,00
371 000 USD	Abbott Laboratories, 3.750%, 30/11/26	365 761	0,14	420 000 USD	Ally Financial Inc, 5.800%, 01/05/25	420 336	0,16
230 000 USD	Abbott Laboratories, 4.750%, 30/11/36	235 828	0,09	200 000 USD	Ally Financial Inc, 7.100%, 15/11/27	208 564	0,08
30 000 USD	Abbott Laboratories, 6.000%, 01/04/39	34 703	0,01	210 000 USD	Alphabet Inc, 1.998%, 15/08/26	198 444	0,07
120 000 USD	Abbott Laboratories, 4.900%, 30/11/46	123 257	0,05	100 000 USD	Alphabet Inc, 0.800%, 15/08/27	89 461	0,03
220 000 USD	AbbVie Inc, 3.800%, 15/03/25	217 248	0,08	20 000 USD	Alphabet Inc, 1.100%, 15/08/30	16 610	0,01
430 000 USD	AbbVie Inc, 3.600%, 14/05/25	422 337	0,16	160 000 USD	Alphabet Inc, 1.900%, 15/08/40	111 349	0,04
375 000 USD	AbbVie Inc, 2.950%, 21/11/26	359 719	0,13	180 000 USD	Alphabet Inc, 2.050%, 15/08/50	112 991	0,04
240 000 USD	AbbVie Inc, 4.250%, 14/11/28	238 942	0,09	80 000 USD	Alphabet Inc, 2.250%, 15/08/60	49 867	0,02
345 000 USD	AbbVie Inc, 4.550%, 15/03/35	338 890	0,13	345 000 USD	Amazon.com Inc, 3.800%, 05/12/24	341 443	0,13
250 000 USD	AbbVie Inc, 4.500%, 14/05/35	244 765	0,09	150 000 USD	Amazon.com Inc, 5.200%, 03/12/25	151 840	0,06
10 000 USD	AbbVie Inc, 4.300%, 14/05/36	9 602	0,00	180 000 USD	Amazon.com Inc, 1.000%, 12/05/26	166 442	0,06
30 000 USD	AbbVie Inc, 4.050%, 21/11/39	27 177	0,01	100 000 USD	Amazon.com Inc, 3.300%, 13/04/27	97 150	0,04
260 000 USD	AbbVie Inc, 4.850%, 15/06/44	254 033	0,09	100 000 USD	Amazon.com Inc, 1.200%, 03/06/27	90 304	0,03
170 000 USD	AbbVie Inc, 4.700%, 14/05/45	162 175	0,06	170 000 USD	Amazon.com Inc, 3.150%, 22/08/27	163 572	0,06
20 000 USD	AbbVie Inc, 4.450%, 14/05/46	18 397	0,01	30 000 USD	Amazon.com Inc, 1.650%, 12/05/28	27 035	0,01
220 000 USD	AbbVie Inc, 4.250%, 21/11/49	196 643	0,07	10 000 USD	Amazon.com Inc, 1.500%, 03/06/30	8 479	0,00
265 000 USD	Adobe Inc, 3.250%, 01/02/25	260 503	0,10	100 000 USD	Amazon.com Inc, 2.100%, 12/05/31	86 252	0,03
50 000 USD	Adobe Inc, 2.300%, 01/02/30	44 898	0,02	30 000 USD	Amazon.com Inc, 4.800%, 05/12/34	31 091	0,01
90 000 USD	AES Corp, 1.375%, 15/01/26	83 301	0,03	170 000 USD	Amazon.com Inc, 3.875%, 22/08/37	158 117	0,06
250 000 USD	AES Corp, 2.450%, 15/01/31	210 397	0,08	230 000 USD	Amazon.com Inc, 4.950%, 05/12/44	237 808	0,09
10 000 USD	Aetna Inc, 6.625%, 15/06/36	11 208	0,00	180 000 USD	Amazon.com Inc, 4.050%, 22/08/47	162 614	0,06
20 000 USD	Aetna Inc, 4.125%, 15/11/42	16 656	0,01	70 000 USD	Amazon.com Inc, 2.500%, 03/06/50	46 744	0,02
120 000 USD	Aetna Inc, 3.875%, 15/08/47	94 223	0,03	100 000 USD	Amazon.com Inc, 3.100%, 12/05/51	74 693	0,03
120 000 USD	Affiliated Managers Group Inc, 3.300%, 15/06/30	106 723	0,04	320 000 USD	Amazon.com Inc, 4.250%, 22/08/57	295 827	0,11
100 000 USD	Aflac Inc, 3.600%, 01/04/30	94 674	0,03	70 000 USD	Amazon.com Inc, 2.700%, 03/06/60	46 549	0,02
50 000 USD	Aflac Inc, 4.000%, 15/10/46	40 956	0,01	450 000 USD	Amazon.com Inc, 3.250%, 12/05/61	332 100	0,12
100 000 USD	Agilent Technologies Inc, 2.750%, 15/09/29	91 601	0,03	60 000 USD	Amcor Finance USA Inc, 3.625%, 28/04/26	58 004	0,02
15 000 USD	Agilent Technologies Inc, 2.100%, 04/06/30	12 926	0,00	250 000 USD	Amcor Flexibles North America Inc, 2.630%, 19/06/30	216 717	0,08
150 000 USD	Agilent Technologies Inc, 2.300%, 12/03/31	130 167	0,05	20 000 USD	Amcor Flexibles North America Inc, 2.690%, 25/05/31	17 295	0,01
620 000 USD	Air Lease Corp, 2.300%, 01/02/25	598 294	0,22	275 000 USD	American Assets Trust LP, 3.375%, 01/02/31	224 867	0,08
160 000 USD	Albemarle Corp, 4.650%, 01/06/27	157 286	0,06	570 000 USD	American Express Co, 4.200%, 06/11/25	563 610	0,21
460 000 USD	Albemarle Corp, 5.050%, 01/06/32	449 788	0,17				
50 000 USD	Albemarle Corp, 5.650%, 01/06/52	46 584	0,02				
140 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 3.450%, 30/04/25	136 811	0,05				
100 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 2.000%, 18/05/32	80 280	0,03				
90 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 1.875%, 01/02/33	70 187	0,03				
100 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 4.850%, 15/04/49	88 771	0,03				
156 000 USD	Alexandria Real Estate Equities Inc, 4.000%, 01/02/50	123 766	0,05				
20 000 USD	Allstate Corp, 1.450%, 15/12/30	16 199	0,01				
95 000 USD	Allstate Corp, 4.200%, 15/12/46	80 906	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
670 000 USD	American Express Co, 2.550%, 04/03/27	628 091	0,23	325 000 USD	American Water Capital Corp, 4.000%, 01/12/46	273 101	0,10
180 000 USD	American Express Co, 5.043%, 01/05/34	179 968	0,07	100 000 USD	American Water Capital Corp, 3.750%, 01/09/47	81 938	0,03
410 000 USD	American Express Co, 5.625%, 28/07/34	425 010	0,16	50 000 USD	American Water Capital Corp, 4.200%, 01/09/48	43 787	0,02
70 000 USD	American Express Co, 4.050%, 03/12/42	63 373	0,02	62 000 USD	American Water Capital Corp, 4.150%, 01/06/49	53 619	0,02
100 000 USD	American Honda Finance Corp, 1.500%, 13/01/25	96 484	0,04	100 000 USD	Amgen Inc, 5.250%, 02/03/25	100 217	0,04
50 000 USD	American Honda Finance Corp, 1.200%, 08/07/25	47 425	0,02	190 000 USD	Amgen Inc, 3.125%, 01/05/25	185 246	0,07
80 000 USD	American Honda Finance Corp, 1.000%, 10/09/25	75 242	0,03	110 000 USD	Amgen Inc, 2.200%, 21/02/27	102 333	0,04
150 000 USD	American Honda Finance Corp, 5.250%, 07/07/26	152 733	0,06	200 000 USD	Amgen Inc, 5.150%, 02/03/28	204 642	0,08
170 000 USD	American Honda Finance Corp, 1.300%, 09/09/26	156 305	0,06	100 000 USD	Amgen Inc, 3.000%, 22/02/29	94 121	0,03
20 000 USD	American Honda Finance Corp, 3.500%, 15/02/28	19 257	0,01	230 000 USD	Amgen Inc, 2.450%, 21/02/30	204 235	0,08
40 000 USD	American Honda Finance Corp, 2.000%, 24/03/28	36 299	0,01	200 000 USD	Amgen Inc, 5.250%, 02/03/33	205 246	0,08
150 000 USD	American Honda Finance Corp, 4.600%, 17/04/30	150 228	0,06	100 000 USD	Amgen Inc, 3.150%, 21/02/40	77 953	0,03
35 000 USD	American Honda Finance Corp, 1.800%, 13/01/31	29 647	0,01	50 000 USD	Amgen Inc, 4.950%, 01/10/41	48 052	0,02
20 000 USD	American International Group Inc, 4.500%, 16/07/44	18 115	0,01	150 000 USD	Amgen Inc, 5.150%, 15/11/41	147 741	0,05
270 000 USD	American International Group Inc, 4.800%, 10/07/45	255 741	0,09	150 000 USD	Amgen Inc, 5.600%, 02/03/43	155 290	0,06
30 000 USD	American Tower Corp, 4.000%, 01/06/25	29 503	0,01	245 000 USD	Amgen Inc, 4.400%, 01/05/45	218 239	0,08
10 000 USD	American Tower Corp, 3.375%, 15/10/26	9 589	0,00	100 000 USD	Amgen Inc, 3.375%, 21/02/50	74 675	0,03
125 000 USD	American Tower Corp, 3.125%, 15/01/27	118 321	0,04	185 000 USD	Amgen Inc, 4.663%, 15/06/51	168 970	0,06
290 000 USD	American Tower Corp, 3.550%, 15/07/27	278 623	0,10	150 000 USD	Amgen Inc, 3.000%, 15/01/52	105 275	0,04
315 000 USD	American Tower Corp, 3.950%, 15/03/29	301 313	0,11	150 000 USD	Amgen Inc, 4.200%, 22/02/52	127 048	0,05
15 000 USD	American Tower Corp, 2.900%, 15/01/30	13 417	0,00	330 000 USD	Amgen Inc, 5.650%, 02/03/53	348 572	0,13
150 000 USD	American Tower Corp, 5.650%, 15/03/33	156 175	0,06	200 000 USD	Amgen Inc, 5.750%, 02/03/63	210 850	0,08
90 000 USD	American Tower Corp, 3.700%, 15/10/49	68 522	0,03	30 000 USD	Amphenol Corp, 2.050%, 01/03/25	28 970	0,01
25 000 USD	American Tower Corp, 3.100%, 15/06/50	17 121	0,01	10 000 USD	Amphenol Corp, 4.350%, 01/06/29	9 981	0,00
100 000 USD	American Water Capital Corp, 3.400%, 01/03/25	97 894	0,04	30 000 USD	Amphenol Corp, 2.800%, 15/02/30	27 372	0,01
150 000 USD	American Water Capital Corp, 3.750%, 01/09/28	144 553	0,05	20 000 USD	Analog Devices Inc, 3.500%, 05/12/26	19 538	0,01
80 000 USD	American Water Capital Corp, 2.800%, 01/05/30	71 756	0,03	100 000 USD	Analog Devices Inc, 2.100%, 01/10/31	85 334	0,03
100 000 USD	American Water Capital Corp, 4.450%, 01/06/32	99 388	0,04	340 000 USD	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.700%, 01/02/36	339 731	0,13
20 000 USD	American Water Capital Corp, 6.593%, 15/10/37	23 271	0,01	485 000 USD	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.900%, 01/02/46	477 390	0,18
				9 000 USD	Anheuser-Busch InBev Finance Inc, 4.700%, 01/02/36	9 016	0,00
				110 000 USD	Anheuser-Busch InBev Finance Inc, 4.900%, 01/02/46	107 441	0,04
				120 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.000%, 13/04/28	118 664	0,04
				20 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.750%, 23/01/29	20 341	0,01
				30 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3.500%, 01/06/30	28 615	0,01
				30 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.375%, 15/04/38	28 517	0,01
				270 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 8.200%, 15/01/39	361 306	0,13
				350 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5.450%, 23/01/39	369 778	0,14

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
275 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 8.000%, 15/11/39	357 522	0,13	20 000 USD	AT&T Inc, 4.350%, 01/03/29	19 750	0,01
11 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.600%, 15/04/48	10 426	0,00	245 000 USD	AT&T Inc, 4.300%, 15/02/30	240 044	0,09
20 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4.439%, 06/10/48	18 484	0,01	355 000 USD	AT&T Inc, 2.750%, 01/06/31	311 481	0,12
200 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5.550%, 23/01/49	215 658	0,08	150 000 USD	AT&T Inc, 2.250%, 01/02/32	124 098	0,05
195 000 USD	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5.800%, 23/01/59	219 309	0,08	420 000 USD	AT&T Inc, 2.550%, 01/12/33	342 569	0,13
170 000 USD	Aon Corp, 3.750%, 02/05/29	162 834	0,06	200 000 USD	AT&T Inc, 5.400%, 15/02/34	206 410	0,08
150 000 USD	Aon Corp, 2.800%, 15/05/30	133 213	0,05	200 000 USD	AT&T Inc, 4.850%, 01/03/39	191 432	0,07
310 000 USD	Aon Corp / Aon Global Holdings PLC, 3.900%, 28/02/52	245 966	0,09	20 000 USD	AT&T Inc, 5.350%, 01/09/40	19 835	0,01
400 000 USD	Apollo Global Management Inc, 6.375%, 15/11/33	431 256	0,16	150 000 USD	AT&T Inc, 3.500%, 01/06/41	119 394	0,04
300 000 USD	Apple Inc, 2.750%, 13/01/25	293 967	0,11	115 000 USD	AT&T Inc, 4.300%, 15/12/42	100 281	0,04
410 000 USD	Apple Inc, 3.200%, 13/05/25	401 948	0,15	100 000 USD	AT&T Inc, 4.350%, 15/06/45	86 726	0,03
280 000 USD	Apple Inc, 3.250%, 23/02/26	273 381	0,10	150 000 USD	AT&T Inc, 4.750%, 15/05/46	136 323	0,05
300 000 USD	Apple Inc, 2.450%, 04/08/26	286 257	0,11	20 000 USD	AT&T Inc, 5.150%, 15/11/46	19 307	0,01
425 000 USD	Apple Inc, 3.350%, 09/02/27	414 192	0,15	30 000 USD	AT&T Inc, 4.500%, 09/03/48	26 289	0,01
20 000 USD	Apple Inc, 3.200%, 11/05/27	19 381	0,01	260 000 USD	AT&T Inc, 4.550%, 09/03/49	228 392	0,08
215 000 USD	Apple Inc, 3.000%, 20/06/27	206 877	0,08	100 000 USD	AT&T Inc, 5.150%, 15/02/50	96 400	0,04
20 000 USD	Apple Inc, 3.000%, 13/11/27	19 210	0,01	130 000 USD	AT&T Inc, 3.650%, 01/06/51	98 188	0,04
300 000 USD	Apple Inc, 2.200%, 11/09/29	271 794	0,10	350 000 USD	AT&T Inc, 3.500%, 15/09/53	255 115	0,09
30 000 USD	Apple Inc, 1.650%, 11/05/30	25 699	0,01	320 000 USD	AT&T Inc, 3.550%, 15/09/55	231 210	0,09
20 000 USD	Apple Inc, 3.850%, 04/05/43	17 864	0,01	350 000 USD	AT&T Inc, 3.800%, 01/12/57	261 180	0,10
130 000 USD	Apple Inc, 4.450%, 06/05/44	126 715	0,05	295 000 USD	AT&T Inc, 3.650%, 15/09/59	212 214	0,08
20 000 USD	Apple Inc, 3.450%, 09/02/45	16 715	0,01	20 000 USD	AT&T Inc, 3.850%, 01/06/60	14 981	0,01
370 000 USD	Apple Inc, 4.375%, 13/05/45	352 488	0,13	15 000 USD	Atmos Energy Corp, 4.150%, 15/01/43	13 524	0,00
220 000 USD	Apple Inc, 4.650%, 23/02/46	217 424	0,08	80 000 USD	Atmos Energy Corp, 4.300%, 01/10/48	71 374	0,03
100 000 USD	Apple Inc, 3.850%, 04/08/46	87 352	0,03	390 000 USD	Atmos Energy Corp, 3.375%, 15/09/49	297 979	0,11
225 000 USD	Apple Inc, 4.250%, 09/02/47	213 109	0,08	60 000 USD	Autodesk Inc, 2.850%, 15/01/30	54 166	0,02
105 000 USD	Apple Inc, 3.750%, 13/11/47	90 151	0,03	20 000 USD	Automatic Data Processing Inc, 3.375%, 15/09/25	19 612	0,01
20 000 USD	Apple Inc, 2.950%, 11/09/49	14 745	0,01	100 000 USD	Automatic Data Processing Inc, 1.700%, 15/05/28	90 377	0,03
120 000 USD	Apple Inc, 2.650%, 11/05/50	82 841	0,03	120 000 USD	Automatic Data Processing Inc, 1.250%, 01/09/30	99 790	0,04
200 000 USD	Apple Inc, 2.650%, 08/02/51	137 310	0,05	100 000 USD	AutoZone Inc, 3.625%, 15/04/25	98 199	0,04
100 000 USD	Apple Inc, 2.700%, 05/08/51	68 990	0,03	100 000 USD	AutoZone Inc, 1.650%, 15/01/31	81 444	0,03
160 000 USD	Apple Inc, 2.550%, 20/08/60	105 946	0,04	250 000 USD	AvalonBay Communities Inc, 3.500%, 15/11/25	243 122	0,09
95 000 USD	Apple Inc, 2.800%, 08/02/61	64 898	0,02	60 000 USD	AvalonBay Communities Inc, 2.300%, 01/03/30	52 373	0,02
15 000 USD	Applied Materials Inc, 3.900%, 01/10/25	14 799	0,01	235 000 USD	AvalonBay Communities Inc, 2.450%, 15/01/31	203 313	0,08
115 000 USD	Applied Materials Inc, 5.100%, 01/10/35	121 043	0,04	170 000 USD	Avangrid Inc, 3.200%, 15/04/25	165 296	0,06
20 000 USD	Applied Materials Inc, 4.350%, 01/04/47	18 955	0,01	100 000 USD	Avangrid Inc, 3.800%, 01/06/29	94 198	0,03
250 000 USD	Assurant Inc, 4.900%, 27/03/28	247 635	0,09	30 000 USD	Avery Dennison Corp, 2.250%, 15/02/32	24 747	0,01
200 000 USD	Assurant Inc, 3.700%, 22/02/30	180 734	0,07	140 000 USD	Avnet Inc, 3.000%, 15/05/31	118 590	0,04
20 000 USD	Astrazeneca Finance LLC, 1.200%, 28/05/26	18 519	0,01	360 000 USD	Avnet Inc, 5.500%, 01/06/32	357 858	0,13
20 000 USD	Astrazeneca Finance LLC, 1.750%, 28/05/28	17 930	0,01	275 000 USD	AXIS Specialty Finance LLC, 3.900%, 15/07/29	260 664	0,10
200 000 USD	AT&T Inc, 1.700%, 25/03/26	187 114	0,07	200 000 USD	Bain Capital Specialty Finance Inc, 2.550%, 13/10/26	180 440	0,07
170 000 USD	AT&T Inc, 3.800%, 15/02/27	165 995	0,06	45 000 USD	Bank of America Corp, 4.000%, 22/01/25	44 390	0,02
20 000 USD	AT&T Inc, 4.250%, 01/03/27	19 797	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 USD	Bank of America Corp, 3.950%, 21/04/25	98 338	0,04	120 000 USD	Bank of America Corp, 3.846%, 08/03/37	105 461	0,04
120 000 USD	Bank of America Corp, 3.366%, 23/01/26	117 214	0,04	230 000 USD	Bank of America Corp, 4.244%, 24/04/38	207 828	0,08
95 000 USD	Bank of America Corp, 2.015%, 13/02/26	91 270	0,03	130 000 USD	Bank of America Corp, 7.750%, 14/05/38	158 317	0,06
210 000 USD	Bank of America Corp, 4.450%, 03/03/26	207 646	0,08	25 000 USD	Bank of America Corp, 2.676%, 19/06/41	17 952	0,01
280 000 USD	Bank of America Corp, 1.319%, 19/06/26	263 539	0,10	210 000 USD	Bank of America Corp, 5.875%, 07/02/42	227 073	0,08
15 000 USD	Bank of America Corp, 4.250%, 22/10/26	14 733	0,01	30 000 USD	Bank of America Corp, 3.311%, 22/04/42	23 490	0,01
380 000 USD	Bank of America Corp, 1.658%, 11/03/27	351 629	0,13	260 000 USD	Bank of America Corp, 5.000%, 21/01/44	256 602	0,09
170 000 USD	Bank of America Corp, 3.559%, 23/04/27	163 724	0,06	120 000 USD	Bank of America Corp, 4.443%, 20/01/48	108 156	0,04
20 000 USD	Bank of America Corp, 3.248%, 21/10/27	19 052	0,01	50 000 USD	Bank of America Corp, 3.946%, 23/01/49	42 073	0,02
15 000 USD	Bank of America Corp, 4.183%, 25/11/27	14 597	0,01	370 000 USD	Bank of America Corp, 4.330%, 15/03/50	325 581	0,12
550 000 USD	Bank of America Corp, 3.824%, 20/01/28	529 089	0,20	130 000 USD	Bank of America Corp, 4.083%, 20/03/51	109 827	0,04
780 000 USD	Bank of America Corp, 3.705%, 24/04/28	745 696	0,28	30 000 USD	Bank of America Corp, 2.972%, 21/07/52	21 200	0,01
50 000 USD	Bank of America Corp, 3.593%, 21/07/28	47 476	0,02	370 000 USD	BANK OF AMERICA CORP, 2.972%, 04/02/33	314 833	0,12
30 000 USD	Bank of America Corp, 3.419%, 20/12/28	28 268	0,01	325 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 3.950%, 18/11/25	319 624	0,12
100 000 USD	Bank of America Corp, 3.970%, 05/03/29	95 568	0,04	20 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 3.400%, 29/01/28	19 094	0,01
400 000 USD	Bank of America Corp, 2.087%, 14/06/29	353 176	0,13	220 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 3.442%, 07/02/28	211 862	0,08
120 000 USD	Bank of America Corp, 4.271%, 23/07/29	115 951	0,04	50 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 1.650%, 14/07/28	44 035	0,02
125 000 USD	Bank of America Corp, 3.974%, 07/02/30	118 603	0,04	410 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 3.000%, 30/10/28	379 365	0,14
110 000 USD	Bank of America Corp, 3.194%, 23/07/30	99 860	0,04	100 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 4.596%, 26/07/30	99 489	0,04
40 000 USD	Bank of America Corp, 2.496%, 13/02/31	34 394	0,01	10 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 1.650%, 28/01/31	8 308	0,00
1 220 000 USD	Bank of America Corp, 2.592%, 29/04/31	1 052 043	0,39	130 000 USD	Bank of New York Mellon Corp, 4.967%, 26/04/34	129 659	0,05
12 000 USD	Bank of America Corp, 1.922%, 24/10/31	9 760	0,00	10 000 USD	Baxalta Inc, 4.000%, 23/06/25	9 837	0,00
225 000 USD	Bank of America Corp, 2.651%, 11/03/32	190 096	0,07	150 000 USD	Baxalta Inc, 5.250%, 23/06/45	150 039	0,06
210 000 USD	Bank of America Corp, 2.299%, 21/07/32	171 746	0,06	460 000 USD	Baxter International Inc, 2.600%, 15/08/26	433 996	0,16
520 000 USD	Bank of America Corp, 2.572%, 20/10/32	431 980	0,16	150 000 USD	Baxter International Inc, 1.730%, 01/04/31	122 142	0,05
300 000 USD	Bank of America Corp, 5.015%, 22/07/33	297 450	0,11	100 000 USD	Baxter International Inc, 3.132%, 01/12/51	69 124	0,03
840 000 USD	Bank of America Corp, 5.288%, 25/04/34	842 545	0,31	74 000 USD	Becton Dickinson & Co, 3.700%, 06/06/27	71 717	0,03
100 000 USD	Bank of America Corp, 2.482%, 21/09/36	79 417	0,03	40 000 USD	Becton Dickinson & Co, 1.957%, 11/02/31	33 388	0,01
150 000 USD	Bank of America Corp, 6.110%, 29/01/37	160 501	0,06	70 000 USD	Becton Dickinson & Co, 4.685%, 15/12/44	65 668	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
40 000 USD	Becton Dickinson & Co, 3.794%, 20/05/50	32 693	0,01	75 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 4.350%, 15/11/47	66 121	0,02
70 000 USD	Berry Global Inc, 1.570%, 15/01/26	65 098	0,02	140 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 4.550%, 20/02/48	127 900	0,05
30 000 USD	Best Buy Co Inc, 4.450%, 01/10/28	29 865	0,01	260 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 4.250%, 26/10/49	226 291	0,08
60 000 USD	Biogen Inc, 4.050%, 15/09/25	59 037	0,02	100 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 3.700%, 15/03/52	78 671	0,03
90 000 USD	Biogen Inc, 2.250%, 01/05/30	76 936	0,03	230 000 USD	Brixmor Operating Partnership LP, 2.250%, 01/04/28	204 458	0,08
10 000 USD	BlackRock Inc, 3.200%, 15/03/27	9 691	0,00	20 000 USD	Brixmor Operating Partnership LP, 4.125%, 15/05/29	19 061	0,01
170 000 USD	BlackRock Inc, 3.250%, 30/04/29	163 637	0,06	250 000 USD	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd, 3.875%, 15/01/27	244 072	0,09
150 000 USD	BlackRock Inc, 1.900%, 28/01/31	126 675	0,05	17 000 USD	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd, 3.500%, 15/01/28	16 313	0,01
200 000 USD	BlackRock Inc, 4.750%, 25/05/33	202 196	0,07	96 000 USD	Broadcom Inc, 4.150%, 15/11/30	91 821	0,03
190 000 USD	Boardwalk Pipelines LP, 4.800%, 03/05/29	186 356	0,07	110 000 USD	Broadcom Inc, 2.450%, 15/02/31	94 241	0,03
550 000 USD	Boardwalk Pipelines LP, 3.600%, 01/09/32	488 592	0,18	185 000 USD	Broadcom Inc, 4.300%, 15/11/32	177 731	0,07
100 000 USD	Booking Holdings Inc, 3.650%, 15/03/25	98 485	0,04	1 010 000 USD	Broadcom Inc, 3.469%, 15/04/34	880 377	0,33
245 000 USD	Booking Holdings Inc, 4.625%, 13/04/30	247 026	0,09	200 000 USD	Broadcom Inc, 3.500%, 15/02/41	159 046	0,06
50 000 USD	BorgWarner Inc, 2.650%, 01/07/27	46 376	0,02	150 000 USD	Broadridge Financial Solutions Inc, 2.900%, 01/12/29	134 508	0,05
12 000 USD	BorgWarner Inc, 4.375%, 15/03/45	9 935	0,00	30 000 USD	Broadridge Financial Solutions Inc, 2.600%, 01/05/31	25 673	0,01
130 000 USD	Boston Properties LP, 3.200%, 15/01/25	126 392	0,05	300 000 USD	Brunswick Corp, 2.400%, 18/08/31	242 397	0,09
10 000 USD	Boston Properties LP, 3.650%, 01/02/26	9 635	0,00	240 000 USD	Brunswick Corp, 4.400%, 15/09/32	219 072	0,08
170 000 USD	Boston Properties LP, 4.500%, 01/12/28	161 847	0,06	150 000 USD	Campbell Soup Co, 3.950%, 15/03/25	147 709	0,05
150 000 USD	Boston Properties LP, 3.400%, 21/06/29	134 845	0,05	90 000 USD	Campbell Soup Co, 4.800%, 15/03/48	82 379	0,03
20 000 USD	Boston Properties LP, 3.250%, 30/01/31	17 204	0,01	30 000 USD	Capital One Financial Corp, 4.250%, 30/04/25	29 579	0,01
100 000 USD	Boston Properties LP, 2.550%, 01/04/32	79 680	0,03	225 000 USD	Capital One Financial Corp, 4.200%, 29/10/25	220 930	0,08
200 000 USD	Boston Properties LP, 2.450%, 01/10/33	152 548	0,06	200 000 USD	Capital One Financial Corp, 2.636%, 03/03/26	191 654	0,07
590 000 USD	Boston Properties LP, 2.900%, perpetual	506 043	0,19	10 000 USD	Capital One Financial Corp, 3.750%, 28/07/26	9 580	0,00
100 000 USD	Boston Scientific Corp, 1.900%, 01/06/25	95 780	0,04	20 000 USD	Capital One Financial Corp, 3.750%, 09/03/27	19 129	0,01
54 000 USD	Boston Scientific Corp, 4.550%, 01/03/39	51 644	0,02	150 000 USD	Capital One Financial Corp, 3.650%, 11/05/27	143 278	0,05
150 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 3.200%, 15/06/26	145 617	0,05	330 000 USD	Capital One Financial Corp, 7.149%, 29/10/27	342 820	0,13
370 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 3.900%, 20/02/28	363 806	0,13	480 000 USD	Capital One Financial Corp, 3.800%, 31/01/28	456 374	0,17
50 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 3.400%, 26/07/29	47 463	0,02	75 000 USD	Capital One Financial Corp, 2.359%, 29/07/32	56 934	0,02
100 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 2.950%, 15/03/32	89 006	0,03	220 000 USD	Capital One Financial Corp, 2.618%, 02/11/32	177 527	0,07
260 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 5.900%, 15/11/33	283 780	0,10	50 000 USD	Cardinal Health Inc, 3.410%, 15/06/27	48 034	0,02
30 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 4.125%, 15/06/39	27 137	0,01				
298 000 USD	Bristol-Myers Squibb Co, 5.000%, 15/08/45	296 149	0,11				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
60 000 USD	Cardinal Health Inc, 4.368%, 15/06/47	51 487	0,02	100 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4.800%, 01/03/50	78 073	0,03
150 000 USD	Carrier Global Corp, 2.722%, 15/02/30	134 437	0,05	440 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.850%, 01/04/61	276 729	0,10
150 000 USD	Carrier Global Corp, 3.577%, 05/04/50	117 429	0,04	250 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4.400%, 01/12/61	173 702	0,06
100 000 USD	Caterpillar Financial Services Corp, 3.400%, 13/05/25	98 289	0,04	150 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5.500%, 01/04/63	125 538	0,05
100 000 USD	Caterpillar Financial Services Corp, 0.800%, 13/11/25	93 393	0,03	210 000 USD	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5.875%, 31/03/25	210 462	0,08
100 000 USD	Caterpillar Inc, 2.600%, 09/04/30	91 079	0,03	100 000 USD	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 3.700%, 15/11/29	94 525	0,03
100 000 USD	Caterpillar Inc, 6.050%, 15/08/36	112 965	0,04	150 000 USD	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2.742%, 31/12/39	119 694	0,04
110 000 USD	Caterpillar Inc, 3.803%, 15/08/42	96 910	0,04	20 000 USD	Chubb Corp, 6.500%, 15/05/38	23 221	0,01
110 000 USD	Caterpillar Inc, 4.300%, 15/05/44	105 191	0,04	150 000 USD	Chubb INA Holdings Inc, 3.350%, 03/05/26	145 828	0,05
50 000 USD	Caterpillar Inc, 3.250%, 19/09/49	39 723	0,01	120 000 USD	Chubb INA Holdings Inc, 1.375%, 15/09/30	99 031	0,04
40 000 USD	Caterpillar Inc, 3.250%, 09/04/50	31 761	0,01	105 000 USD	Chubb INA Holdings Inc, 4.350%, 03/11/45	98 874	0,04
20 000 USD	Caterpillar Inc, 4.750%, 15/05/64	19 481	0,01	150 000 USD	Chubb INA Holdings Inc, 3.050%, 15/12/61	107 979	0,04
250 000 USD	CBRE Services Inc, 4.875%, 01/03/26	249 895	0,09	500 000 USD	Church & Dwight Co Inc, 2.300%, 15/12/31	425 265	0,16
230 000 USD	CBRE Services Inc, 5.950%, 15/08/34	241 387	0,09	230 000 USD	Cigna Group, 4.125%, 15/11/25	227 058	0,08
100 000 USD	Celanese US Holdings LLC, 6.165%, 15/07/27	102 638	0,04	100 000 USD	Cigna Group, 3.400%, 01/03/27	96 451	0,04
300 000 USD	Celanese US Holdings LLC, 6.550%, 15/11/30	317 880	0,12	230 000 USD	Cigna Group, 4.375%, 15/10/28	227 958	0,08
100 000 USD	Celanese US Holdings LLC, 6.379%, 15/07/32	105 912	0,04	15 000 USD	Cigna Group, 2.375%, 15/03/31	12 821	0,00
15 000 USD	Cencora Inc, 3.450%, 15/12/27	14 440	0,01	120 000 USD	Cigna Group, 4.800%, 15/08/38	116 261	0,04
50 000 USD	Cencora Inc, 2.700%, 15/03/31	43 896	0,02	50 000 USD	Cigna Group, 6.125%, 15/11/41	54 924	0,02
600 000 USD	Centene Corp, 3.000%, 15/10/30	522 408	0,19	100 000 USD	Cigna Group, 4.800%, 15/07/46	94 243	0,03
400 000 USD	Centene Corp, 2.625%, 01/08/31	333 872	0,12	180 000 USD	Cigna Group, 4.900%, 15/12/48	171 247	0,06
350 000 USD	Charles Schwab Corp, 4.200%, 24/03/25	345 968	0,13	165 000 USD	Cigna Group, 3.400%, 15/03/50	122 248	0,05
230 000 USD	Charles Schwab Corp, 2.000%, 20/03/28	204 884	0,08	195 000 USD	Cintas Corp No 2, 3.700%, 01/04/27	190 690	0,07
360 000 USD	Charles Schwab Corp, 3.250%, 22/05/29	337 597	0,12	100 000 USD	Cisco Systems Inc, 2.500%, 20/09/26	95 423	0,04
300 000 USD	Charles Schwab Corp, 2.750%, 01/10/29	270 534	0,10	235 000 USD	Cisco Systems Inc, 5.900%, 15/02/39	261 247	0,10
360 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6.384%, 23/10/35	366 559	0,14	90 000 USD	Cisco Systems Inc, 5.500%, 15/01/40	96 089	0,04
300 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5.375%, 01/04/38	272 025	0,10	150 000 USD	Citibank NA, 5.864%, 29/09/25	152 539	0,06
250 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6.484%, 23/10/45	246 855	0,09	270 000 USD	Citigroup Inc, 3.875%, 26/03/25	265 051	0,10
200 000 USD	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5.375%, 01/05/47	170 876	0,06	120 000 USD	Citigroup Inc, 4.400%, 10/06/25	118 645	0,04
				35 000 USD	Citigroup Inc, 3.700%, 12/01/26	34 187	0,01
				150 000 USD	Citigroup Inc, 2.014%, 25/01/26	144 139	0,05
				70 000 USD	Citigroup Inc, 4.600%, 09/03/26	69 129	0,03
				230 000 USD	Citigroup Inc, 3.106%, 08/04/26	223 650	0,08

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
480 000 USD	Citigroup Inc, 3.400%, 01/05/26	463 440	0,17	280 000 USD	Comcast Corp, 4.600%, 15/10/38	271 793	0,10
100 000 USD	Citigroup Inc, 5.610%, 29/09/26	100 749	0,04	700 000 USD	Comcast Corp, 6.550%, 01/07/39	804 048	0,30
20 000 USD	Citigroup Inc, 3.200%, 21/10/26	19 081	0,01	350 000 USD	Comcast Corp, 4.700%, 15/10/48	334 915	0,12
225 000 USD	Citigroup Inc, 4.300%, 20/11/26	220 673	0,08	15 000 USD	Comcast Corp, 3.999%, 01/11/49	12 565	0,00
300 000 USD	Citigroup Inc, 1.122%, 28/01/27	275 850	0,10	235 000 USD	Comcast Corp, 4.049%, 01/11/52	198 613	0,07
262 000 USD	Citigroup Inc, 4.450%, 29/09/27	256 097	0,09	350 000 USD	Comcast Corp, 4.950%, 15/10/58	345 156	0,13
150 000 USD	Citigroup Inc, 3.887%, 10/01/28	145 177	0,05	400 000 USD	Comcast Corp, 2.650%, 15/08/62	246 356	0,09
30 000 USD	Citigroup Inc, 3.520%, 27/10/28	28 391	0,01	130 000 USD	Comcast Corp, 2.987%, 01/11/63	84 215	0,03
200 000 USD	Citigroup Inc, 4.075%, 23/04/29	192 832	0,07	470 000 USD	Comerica Inc, 4.000%, 01/02/29	444 681	0,16
50 000 USD	Citigroup Inc, 3.980%, 20/03/30	47 445	0,02	50 000 USD	Conagra Brands Inc, 4.600%, 01/11/25	49 560	0,02
405 000 USD	Citigroup Inc, 4.412%, 31/03/31	388 059	0,14	260 000 USD	Conagra Brands Inc, 4.850%, 01/11/28	260 190	0,10
30 000 USD	Citigroup Inc, 2.572%, 03/06/31	25 664	0,01	100 000 USD	Conagra Brands Inc, 5.300%, 01/11/38	98 181	0,04
370 000 USD	Citigroup Inc, 3.057%, 25/01/33	316 095	0,12	70 000 USD	Conagra Brands Inc, 5.400%, 01/11/48	67 943	0,02
180 000 USD	Citigroup Inc, 3.785%, 17/03/33	162 144	0,06	490 000 USD	Concentrix Corp, 6.850%, 02/08/33	504 636	0,19
25 000 USD	Citigroup Inc, 6.000%, 31/10/33	26 418	0,01	100 000 USD	Connecticut Light and Power Co, 4.900%, 01/07/33	101 200	0,04
200 000 USD	Citigroup Inc, 8.125%, 15/07/39	258 630	0,10	245 000 USD	Constellation Brands Inc, 3.600%, 15/02/28	235 489	0,09
100 000 USD	Citigroup Inc, 5.875%, 30/01/42	106 765	0,04	120 000 USD	Constellation Brands Inc, 3.150%, 01/08/29	111 649	0,04
700 000 USD	Citigroup Inc, 2.904%, 03/11/42	504 889	0,19	55 000 USD	Constellation Brands Inc, 5.250%, 15/11/48	54 584	0,02
110 000 USD	Citigroup Inc, 6.675%, 13/09/43	123 845	0,05	630 000 USD	Corebridge Financial Inc, 6.875%, 15/12/52	628 110	0,23
70 000 USD	Citigroup Inc, 4.650%, 30/07/45	63 818	0,02	10 000 USD	Corning Inc, 5.350%, 15/11/48	10 009	0,00
160 000 USD	Citigroup Inc, 4.750%, 18/05/46	143 878	0,05	60 000 USD	Corning Inc, 5.850%, 15/11/68	60 470	0,02
140 000 USD	Citigroup Inc, 4.650%, 23/07/48	129 471	0,05	90 000 USD	Corning Inc, 5.450%, 15/11/79	86 659	0,03
340 000 USD	Citizens Bank NA/Providence RI, 2.250%, 28/04/25	325 050	0,12	160 000 USD	Costco Wholesale Corp, 1.375%, 20/06/27	145 357	0,05
30 000 USD	CNH Industrial Capital LLC, 1.875%, 15/01/26	28 146	0,01	200 000 USD	Costco Wholesale Corp, 1.600%, 20/04/30	171 532	0,06
30 000 USD	CNH Industrial Capital LLC, 1.450%, 15/07/26	27 549	0,01	55 000 USD	Costco Wholesale Corp, 1.750%, 20/04/32	45 838	0,02
20 000 USD	CNO Financial Group Inc, 5.250%, 30/05/29	19 816	0,01	175 000 USD	Crown Castle Inc, 1.350%, 15/07/25	165 245	0,06
30 000 USD	Coca-Cola Co, 2.900%, 25/05/27	28 745	0,01	690 000 USD	Crown Castle Inc, 3.800%, 15/02/28	656 169	0,24
320 000 USD	Coca-Cola Co, 1.650%, 01/06/30	274 346	0,10	20 000 USD	Crown Castle Inc, 4.300%, 15/02/29	19 287	0,01
15 000 USD	Coca-Cola Co, 1.375%, 15/03/31	12 389	0,00	80 000 USD	Crown Castle Inc, 3.300%, 01/07/30	71 871	0,03
20 000 USD	Coca-Cola Co, 2.500%, 01/06/40	15 156	0,01	25 000 USD	Crown Castle Inc, 2.100%, 01/04/31	20 390	0,01
300 000 USD	Coca-Cola Co, 4.200%, 25/03/50	280 617	0,10	100 000 USD	Crown Castle Inc, 2.900%, 01/04/41	71 545	0,03
510 000 USD	Coca-Cola Co, 3.000%, 05/03/51	386 570	0,14	50 000 USD	Crown Castle Inc, 4.750%, 15/05/47	43 530	0,02
20 000 USD	Coca-Cola Co, 2.750%, 01/06/60	13 959	0,00	50 000 USD	Crown Castle Inc, 4.000%, 15/11/49	39 715	0,01
100 000 USD	Colgate-Palmolive Co, 4.800%, 02/03/26	101 187	0,04	91 000 USD	Crown Castle Inc, 3.250%, 15/01/51	63 893	0,02
50 000 USD	Colgate-Palmolive Co, 4.600%, 01/03/33	51 873	0,02				
180 000 USD	Colgate-Palmolive Co, 4.000%, 15/08/45	166 264	0,06				
380 000 USD	Comcast Corp, 3.375%, 15/02/25	373 206	0,14				
120 000 USD	Comcast Corp, 3.950%, 15/10/25	118 463	0,04				
240 000 USD	Comcast Corp, 3.150%, 01/03/26	233 066	0,09				
20 000 USD	Comcast Corp, 3.300%, 01/02/27	19 309	0,01				
30 000 USD	Comcast Corp, 3.300%, 01/04/27	28 940	0,01				
8 000 USD	Comcast Corp, 3.150%, 15/02/28	7 635	0,00				
440 000 USD	Comcast Corp, 4.150%, 15/10/28	434 346	0,16				
20 000 USD	Comcast Corp, 2.650%, 01/02/30	18 012	0,01				
20 000 USD	Comcast Corp, 4.250%, 15/10/30	19 733	0,01				
9 000 USD	Comcast Corp, 6.500%, 15/11/35	10 316	0,00				
360 000 USD	Comcast Corp, 3.900%, 01/03/38	322 812	0,12				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
20 000 USD	CSX Corp, 3.250%, 01/06/27	19 297	0,01	70 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 3.375%, 15/12/41	53 110	0,02
300 000 USD	CSX Corp, 4.250%, 15/03/29	299 928	0,11	510 000 USD	Dick's Sporting Goods Inc, 3.150%, 15/01/32	435 147	0,16
100 000 USD	CSX Corp, 2.400%, 15/02/30	88 606	0,03	40 000 USD	Dick's Sporting Goods Inc, 4.100%, 15/01/52	28 697	0,01
110 000 USD	CSX Corp, 6.220%, 30/04/40	124 140	0,05	520 000 USD	Digital Realty Trust LP, 3.700%, 15/08/27	502 507	0,19
10 000 USD	CSX Corp, 5.500%, 15/04/41	10 458	0,00	780 000 USD	Discover Bank, 4.650%, 13/09/28	744 565	0,28
100 000 USD	CSX Corp, 4.100%, 15/03/44	87 840	0,03	20 000 USD	Discovery Communications LLC, 4.900%, 11/03/26	19 953	0,01
170 000 USD	CSX Corp, 3.800%, 01/11/46	141 550	0,05	200 000 USD	Discovery Communications LLC, 3.625%, 15/05/30	181 688	0,07
300 000 USD	CSX Corp, 4.300%, 01/03/48	267 192	0,10	20 000 USD	Discovery Communications LLC, 5.200%, 20/09/47	17 284	0,01
280 000 USD	CSX Corp, 4.750%, 15/11/48	267 103	0,10	100 000 USD	Discovery Communications LLC, 5.300%, 15/05/49	86 656	0,03
300 000 USD	CSX Corp, 3.350%, 15/09/49	227 565	0,08	100 000 USD	Discovery Communications LLC, 4.000%, 15/09/55	71 294	0,03
100 000 USD	CSX Corp, 3.800%, 15/04/50	81 889	0,03	200 000 USD	Dollar General Corp, 5.450%, 05/07/33	204 160	0,08
150 000 USD	CSX Corp, 4.500%, 15/11/52	139 797	0,05	100 000 USD	Dollar Tree Inc, 4.200%, 15/05/28	97 989	0,04
120 000 USD	CSX Corp, 4.250%, 01/11/66	102 779	0,04	30 000 USD	Dollar Tree Inc, 2.650%, 01/12/31	25 522	0,01
100 000 USD	CSX Corp, 4.650%, 01/03/68	92 222	0,03	60 000 USD	Dollar Tree Inc, 3.375%, 01/12/51	41 788	0,02
90 000 USD	Cummins Inc, 0.750%, 01/09/25	84 405	0,03	50 000 USD	Dominion Energy Inc, 2.250%, 15/08/31	41 427	0,02
60 000 USD	Cummins Inc, 1.500%, 01/09/30	50 195	0,02	80 000 USD	DTE Electric Co, 1.900%, 01/04/28	72 020	0,03
10 000 USD	Cummins Inc, 2.600%, 01/09/50	6 652	0,00	130 000 USD	DTE Electric Co, 3.250%, 01/04/51	95 724	0,04
15 000 USD	CVS Health Corp, 4.100%, 25/03/25	14 857	0,01	100 000 USD	Duke Energy Carolinas LLC, 3.950%, 15/11/28	98 442	0,04
220 000 USD	CVS Health Corp, 3.875%, 20/07/25	216 229	0,08	150 000 USD	Duke Energy Florida LLC, 2.500%, 01/12/29	133 947	0,05
512 000 USD	CVS Health Corp, 4.300%, 25/03/28	503 859	0,19	20 000 USD	DuPont de Nemours Inc, 4.493%, 15/11/25	19 883	0,01
10 000 USD	CVS Health Corp, 3.750%, 01/04/30	9 423	0,00	70 000 USD	DuPont de Nemours Inc, 4.725%, 15/11/28	71 205	0,03
190 000 USD	CVS Health Corp, 5.250%, 30/01/31	195 238	0,07	110 000 USD	DuPont de Nemours Inc, 5.319%, 15/11/38	113 198	0,04
50 000 USD	CVS Health Corp, 1.875%, 28/02/31	41 212	0,02	125 000 USD	DuPont de Nemours Inc, 5.419%, 15/11/48	130 802	0,05
100 000 USD	CVS Health Corp, 5.300%, 01/06/33	102 633	0,04	50 000 USD	Eaton Corp, 3.103%, 15/09/27	47 898	0,02
505 000 USD	CVS Health Corp, 4.780%, 25/03/38	478 831	0,18	60 000 USD	Eaton Corp, 4.150%, 02/11/42	55 171	0,02
10 000 USD	CVS Health Corp, 2.700%, 21/08/40	7 154	0,00	20 000 USD	eBay Inc, 1.900%, 11/03/25	19 235	0,01
170 000 USD	CVS Health Corp, 5.125%, 20/07/45	161 430	0,06	120 000 USD	eBay Inc, 3.650%, 10/05/51	92 000	0,03
535 000 USD	CVS Health Corp, 5.050%, 25/03/48	502 558	0,19	180 000 USD	Ecolab Inc, 4.800%, 24/03/30	185 155	0,07
10 000 USD	CVS Health Corp, 4.250%, 01/04/50	8 352	0,00	75 000 USD	Ecolab Inc, 2.750%, 18/08/55	50 611	0,02
200 000 USD	CVS Health Corp, 5.875%, 01/06/53	211 154	0,08	10 000 USD	Edison International, 5.750%, 15/06/27	10 228	0,00
10 000 USD	Danaher Corp, 3.350%, 15/09/25	9 778	0,00	145 000 USD	Electronic Arts Inc, 2.950%, 15/02/51	102 825	0,04
110 000 USD	Deere & Co, 3.100%, 15/04/30	102 153	0,04	320 000 USD	Elevance Health Inc, 2.375%, 15/01/25	310 970	0,11
60 000 USD	Deere & Co, 3.900%, 09/06/42	54 094	0,02	20 000 USD	Elevance Health Inc, 4.101%, 01/03/28	19 693	0,01
100 000 USD	Deere & Co, 3.750%, 15/04/50	87 903	0,03				
50 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 5.850%, 15/07/25	50 496	0,02				
191 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 6.020%, 15/06/26	195 490	0,07				
370 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 5.300%, 01/10/29	381 544	0,14				
71 000 USD	Dell International LLC / EMC Corp, 8.100%, 15/07/36	87 414	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
130 000 USD	Elevance Health Inc, 2.550%, 15/03/31	112 797	0,04	345 000 USD	Essex Portfolio LP, 2.650%, 15/03/32	287 806	0,11
150 000 USD	Elevance Health Inc, 4.650%, 15/01/43	139 051	0,05	240 000 USD	Estee Lauder Cos Inc, 2.600%, 15/04/30	213 026	0,08
15 000 USD	Elevance Health Inc, 5.100%, 15/01/44	14 696	0,01	450 000 USD	Estee Lauder Cos Inc, 4.650%, 15/05/33	453 357	0,17
110 000 USD	Elevance Health Inc, 4.375%, 01/12/47	98 377	0,04	70 000 USD	Estee Lauder Cos Inc, 4.150%, 15/03/47	60 722	0,02
370 000 USD	Elevance Health Inc, 3.600%, 15/03/51	291 090	0,11	225 000 USD	Everest Reinsurance Holdings Inc, 3.500%, 15/10/50	166 504	0,06
150 000 USD	Eli Lilly & Co, 3.375%, 15/03/29	144 420	0,05	20 000 USD	Everest Reinsurance Holdings Inc, 3.125%, 15/10/52	13 744	0,00
200 000 USD	Eli Lilly & Co, 3.950%, 15/03/49	178 510	0,07	50 000 USD	Evergy Kansas Central Inc, 2.550%, 01/07/26	47 377	0,02
375 000 USD	Eli Lilly & Co, 2.250%, 15/05/50	243 394	0,09	100 000 USD	Eversource Energy, 4.600%, 01/07/27	99 331	0,04
35 000 USD	Eli Lilly & Co, 4.150%, 15/03/59	32 192	0,01	200 000 USD	Eversource Energy, 3.375%, 01/03/32	177 436	0,07
100 000 USD	Eli Lilly & Co, 4.950%, 27/02/63	104 066	0,04	20 000 USD	Expedia Group Inc, 5.000%, 15/02/26	20 006	0,01
50 000 USD	Emerson Electric Co, 0.875%, 15/10/26	45 390	0,02	350 000 USD	Expedia Group Inc, 3.800%, 15/02/28	337 540	0,12
300 000 USD	Emerson Electric Co, 2.000%, 21/12/28	268 905	0,10	100 000 USD	Expedia Group Inc, 3.250%, 15/02/30	91 784	0,03
20 000 USD	Emerson Electric Co, 1.950%, 15/10/30	17 282	0,01	10 000 USD	Extra Space Storage LP, 3.500%, 01/07/26	9 630	0,00
100 000 USD	Emerson Electric Co, 2.750%, 15/10/50	68 763	0,03	230 000 USD	Extra Space Storage LP, 2.400%, 15/10/31	189 948	0,07
50 000 USD	Emerson Electric Co, 2.800%, 21/12/51	34 567	0,01	100 000 USD	Federal Realty OP LP, 1.250%, 15/02/26	92 306	0,03
50 000 USD	Enbridge Energy Partners LP, 5.500%, 15/09/40	49 291	0,02	180 000 USD	Federal Realty OP LP, 3.500%, 01/06/30	163 654	0,06
20 000 USD	Enbridge Energy Partners LP, 7.375%, 15/10/45	23 653	0,01	15 000 USD	Federal Realty OP LP, 4.500%, 01/12/44	12 586	0,00
100 000 USD	Equinix Inc, 1.000%, 15/09/25	93 392	0,03	115 000 USD	FedEx Corp, 3.250%, 01/04/26	111 267	0,04
230 000 USD	Equinix Inc, 2.900%, 18/11/26	218 861	0,08	90 000 USD	FedEx Corp, 4.250%, 15/05/30	88 106	0,03
100 000 USD	Equinix Inc, 1.550%, 15/03/28	87 991	0,03	15 000 USD	FedEx Corp, 3.900%, 01/02/35	13 746	0,00
100 000 USD	Equinix Inc, 3.200%, 18/11/29	92 054	0,03	50 000 USD	FedEx Corp, 3.250%, 15/05/41	38 762	0,01
15 000 USD	Equinix Inc, 2.150%, 15/07/30	12 742	0,00	90 000 USD	FedEx Corp, 5.100%, 15/01/44	87 224	0,03
100 000 USD	Equinix Inc, 2.500%, 15/05/31	85 148	0,03	15 000 USD	FedEx Corp, 4.100%, 01/02/45	12 678	0,00
100 000 USD	Equinix Inc, 3.900%, 15/04/32	93 052	0,03	80 000 USD	FedEx Corp, 4.750%, 15/11/45	73 828	0,03
60 000 USD	Equinix Inc, 3.000%, 15/07/50	41 030	0,02	80 000 USD	FedEx Corp, 4.550%, 01/04/46	71 807	0,03
10 000 USD	Equinix Inc, 3.400%, 15/02/52	7 341	0,00	20 000 USD	FedEx Corp, 4.950%, 17/10/48	19 029	0,01
340 000 USD	Equinix Inc, 1.250%, perpetual	320 107	0,12	280 000 USD	FedEx Corp, 5.250%, 15/05/50	279 376	0,10
50 000 USD	ERP Operating LP, 3.250%, 01/08/27	47 605	0,02	125 938 USD	FedEx Corp 2020-1 Class AA Pass Through Trust, 1.875%, 20/02/34	105 175	0,04
10 000 USD	ERP Operating LP, 3.500%, 01/03/28	9 567	0,00	110 000 USD	Fidelity National Financial Inc, 3.400%, 15/06/30	98 782	0,04
100 000 USD	ERP Operating LP, 4.150%, 01/12/28	98 214	0,04	15 000 USD	Fidelity National Financial Inc, 2.450%, 15/03/31	12 454	0,00
50 000 USD	ERP Operating LP, 1.850%, 01/08/31	41 103	0,02	80 000 USD	Fidelity National Information Services Inc, 1.150%, 01/03/26	73 961	0,03
60 000 USD	ERP Operating LP, 4.500%, 01/07/44	53 340	0,02	50 000 USD	Fidelity National Information Services Inc, 2.250%, 01/03/31	42 327	0,02
100 000 USD	Essential Utilities Inc, 2.400%, 01/05/31	83 695	0,03	25 000 USD	Fidelity National Information Services Inc, 3.100%, 01/03/41	18 678	0,01
130 000 USD	Essential Utilities Inc, 4.276%, 01/05/49	108 576	0,04				
100 000 USD	Essential Utilities Inc, 5.300%, 01/05/52	96 272	0,04				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 USD	Fidelity National Information Services Inc, 5.625%, 15/07/52	102 481	0,04	20 000 USD	General Motors Co, 6.125%, 01/10/25	20 268	0,01
50 000 USD	Fifth Third Bancorp, 2.375%, 28/01/25	48 377	0,02	220 000 USD	General Motors Co, 6.800%, 01/10/27	233 539	0,09
40 000 USD	Fifth Third Bancorp, 2.550%, 05/05/27	36 856	0,01	400 000 USD	General Motors Co, 5.000%, 01/10/28	403 700	0,15
100 000 USD	Fifth Third Bancorp, 1.707%, 01/11/27	90 179	0,03	150 000 USD	General Motors Co, 5.600%, 15/10/32	153 598	0,06
340 000 USD	Fifth Third Bancorp, 3.950%, 14/03/28	326 563	0,12	30 000 USD	General Motors Co, 6.600%, 01/04/36	32 136	0,01
100 000 USD	Fifth Third Bancorp, 4.772%, 28/07/30	98 141	0,04	60 000 USD	General Motors Co, 5.150%, 01/04/38	56 943	0,02
30 000 USD	Fifth Third Bancorp, 8.250%, 01/03/38	35 580	0,01	790 000 USD	General Motors Co, 6.750%, 01/04/46	849 321	0,31
100 000 USD	Fifth Third Bank NA, 2.250%, 01/02/27	92 204	0,03	130 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 4.350%, 09/04/25	128 164	0,05
490 000 USD	First American Financial Corp, 2.400%, 15/08/31	387 570	0,14	200 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 6.050%, 10/10/25	202 572	0,07
310 000 USD	Fiserv Inc, 4.200%, 01/10/28	303 738	0,11	100 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 5.250%, 01/03/26	100 097	0,04
20 000 USD	Fiserv Inc, 3.500%, 01/07/29	18 855	0,01	200 000 USD	General Motors Financial Co Inc, 3.600%, 21/06/30	182 062	0,07
20 000 USD	Fiserv Inc, 2.650%, 01/06/30	17 642	0,01	470 000 USD	Genuine Parts Co, 6.500%, 01/11/28	499 878	0,18
125 000 USD	Fiserv Inc, 4.400%, 01/07/49	110 299	0,04	130 000 USD	Gilead Sciences Inc, 3.500%, 01/02/25	127 973	0,05
140 000 USD	Flowserve Corp, 3.500%, 01/10/30	124 397	0,05	170 000 USD	Gilead Sciences Inc, 3.650%, 01/03/26	166 408	0,06
90 000 USD	FMC Corp, 4.500%, 01/10/49	70 844	0,03	60 000 USD	Gilead Sciences Inc, 2.950%, 01/03/27	57 171	0,02
300 000 USD	Ford Motor Co, 3.250%, 12/02/32	249 921	0,09	40 000 USD	Gilead Sciences Inc, 1.650%, 01/10/30	33 552	0,01
300 000 USD	Ford Motor Co, 6.100%, 19/08/32	303 117	0,11	90 000 USD	Gilead Sciences Inc, 4.600%, 01/09/35	88 963	0,03
150 000 USD	Ford Motor Co, 5.291%, 08/12/46	132 148	0,05	120 000 USD	Gilead Sciences Inc, 5.650%, 01/12/41	128 464	0,05
300 000 USD	Ford Motor Credit Co LLC, 6.950%, 06/03/26	307 545	0,11	100 000 USD	Gilead Sciences Inc, 4.800%, 01/04/44	96 726	0,04
100 000 USD	Ford Motor Credit Co LLC, 4.271%, 09/01/27	96 033	0,04	60 000 USD	Gilead Sciences Inc, 4.500%, 01/02/45	55 663	0,02
500 000 USD	Ford Motor Credit Co LLC, 7.350%, 04/11/27	527 080	0,19	175 000 USD	Gilead Sciences Inc, 4.750%, 01/03/46	167 358	0,06
200 000 USD	Ford Motor Credit Co LLC, 6.798%, 07/11/28	209 468	0,08	60 000 USD	Gilead Sciences Inc, 4.150%, 01/03/47	52 367	0,02
300 000 USD	Ford Motor Credit Co LLC, 7.350%, 06/03/30	322 029	0,12	50 000 USD	Gilead Sciences Inc, 2.800%, 01/10/50	34 612	0,01
20 000 USD	Fortive Corp, 3.150%, 15/06/26	19 155	0,01	70 000 USD	GlaxoSmithKline Capital Inc, 3.625%, 15/05/25	68 835	0,03
80 000 USD	Fortive Corp, 4.300%, 15/06/46	68 038	0,02	20 000 USD	GlaxoSmithKline Capital Inc, 3.875%, 15/05/28	19 746	0,01
20 000 USD	Fortune Brands Innovations Inc, 3.250%, 15/09/29	18 512	0,01	120 000 USD	GlaxoSmithKline Capital Inc, 6.375%, 15/05/38	139 674	0,05
170 000 USD	Fortune Brands Innovations Inc, 4.000%, 25/03/32	158 549	0,06	25 000 USD	Global Payments Inc, 4.800%, 01/04/26	24 803	0,01
15 000 USD	GATX Corp, 4.700%, 01/04/29	14 894	0,01	50 000 USD	Global Payments Inc, 2.150%, 15/01/27	46 060	0,02
80 000 USD	GATX Corp, 4.000%, 30/06/30	75 210	0,03	160 000 USD	Global Payments Inc, 3.200%, 15/08/29	145 139	0,05
14 000 USD	General Electric Co, 6.875%, 10/01/39	17 041	0,01				
200 000 USD	General Electric Co, 4.350%, 01/05/50	181 818	0,07				
60 000 USD	General Mills Inc, 4.000%, 17/04/25	59 220	0,02				
90 000 USD	General Mills Inc, 4.200%, 17/04/28	88 736	0,03				
30 000 USD	General Mills Inc, 3.000%, 01/02/51	20 979	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
70 000 USD	Global Payments Inc, 4.150%, 15/08/49	55 495	0,02	10 000 USD	Hasbro Inc, 3.500%, 15/09/27	9 432	0,00
150 000 USD	Global Payments Inc, 5.950%, 15/08/52	153 760	0,06	120 000 USD	Hasbro Inc, 3.900%, 19/11/29	111 880	0,04
210 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.500%, 23/01/25	206 023	0,08	75 000 USD	Hasbro Inc, 6.350%, 15/03/40	78 248	0,03
310 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.500%, 01/04/25	303 335	0,11	25 000 USD	Hasbro Inc, 5.100%, 15/05/44	22 523	0,01
30 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.750%, 22/05/25	29 425	0,01	275 000 USD	HCA Inc, 5.250%, 15/04/25	274 967	0,10
200 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 4.250%, 21/10/25	196 320	0,07	280 000 USD	HCA Inc, 5.250%, 15/06/26	281 142	0,10
200 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 1.093%, 09/12/26	184 338	0,07	160 000 USD	HCA Inc, 4.500%, 15/02/27	157 850	0,06
275 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.850%, 26/01/27	267 611	0,10	870 000 USD	HCA Inc, 2.375%, 15/07/31	721 004	0,27
75 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 1.431%, 09/03/27	69 161	0,03	180 000 USD	HCA Inc, 5.500%, 15/06/47	173 623	0,06
1 120 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.615%, 15/03/28	1 075 099	0,40	10 000 USD	HCA Inc, 5.250%, 15/06/49	9 319	0,00
380 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.691%, 05/06/28	363 576	0,13	40 000 USD	HCA Inc, 3.500%, 15/07/51	28 203	0,01
266 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.814%, 23/04/29	252 660	0,09	100 000 USD	Healthpeak OP LLC, 1.350%, 01/02/27	89 783	0,03
470 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 4.223%, 01/05/29	454 481	0,17	100 000 USD	Healthpeak OP LLC, 2.125%, 01/12/28	87 895	0,03
40 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.800%, 15/03/30	37 655	0,01	70 000 USD	Healthpeak OP LLC, 3.500%, 15/07/29	65 335	0,02
250 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 2.615%, 22/04/32	210 027	0,08	340 000 USD	Hershey Co, 0.900%, 01/06/25	322 351	0,12
20 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 2.383%, 21/07/32	16 430	0,01	260 000 USD	Hewlett Packard Enterprise Co, 4.900%, 15/10/25	259 022	0,10
510 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 2.650%, 21/10/32	425 600	0,16	225 000 USD	Hewlett Packard Enterprise Co, 6.350%, 15/10/45	243 846	0,09
230 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 6.750%, 01/10/37	254 063	0,09	100 000 USD	Highwoods Realty LP, 3.050%, 15/02/30	82 888	0,03
150 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 4.411%, 23/04/39	136 162	0,05	20 000 USD	Home Depot Inc, 3.350%, 15/09/25	19 622	0,01
320 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 6.250%, 01/02/41	357 206	0,13	130 000 USD	Home Depot Inc, 3.000%, 01/04/26	126 084	0,05
140 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 3.210%, 22/04/42	107 451	0,04	20 000 USD	Home Depot Inc, 2.500%, 15/04/27	18 879	0,01
200 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 2.908%, 21/07/42	146 332	0,05	10 000 USD	Home Depot Inc, 2.800%, 14/09/27	9 521	0,00
20 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 4.800%, 08/07/44	18 977	0,01	150 000 USD	Home Depot Inc, 3.900%, 06/12/28	147 774	0,05
140 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 5.150%, 22/05/45	135 647	0,05	10 000 USD	Home Depot Inc, 2.700%, 15/04/30	9 119	0,00
70 000 USD	Goldman Sachs Group Inc, 4.750%, 21/10/45	66 663	0,02	100 000 USD	Home Depot Inc, 1.375%, 15/03/31	81 832	0,03
330 000 USD	Hanover Insurance Group Inc, 2.500%, 01/09/30	271 696	0,10	290 000 USD	Home Depot Inc, 1.875%, 15/09/31	243 110	0,09
410 000 USD	Harman International Industries Inc, 4.150%, 15/05/25	403 747	0,15	130 000 USD	Home Depot Inc, 5.875%, 16/12/36	145 621	0,05
10 000 USD	Hartford Financial Services Group Inc, 4.400%, 15/03/48	8 784	0,00	150 000 USD	Home Depot Inc, 3.300%, 15/04/40	124 560	0,05
110 000 USD	Hartford Financial Services Group Inc, 3.600%, 19/08/49	85 251	0,03	100 000 USD	Home Depot Inc, 4.200%, 01/04/43	91 217	0,03
				15 000 USD	Home Depot Inc, 4.875%, 15/02/44	14 900	0,01
				100 000 USD	Home Depot Inc, 4.400%, 15/03/45	93 183	0,03
				120 000 USD	Home Depot Inc, 4.500%, 06/12/48	113 490	0,04
				120 000 USD	Home Depot Inc, 3.350%, 15/04/50	93 287	0,03
				100 000 USD	Home Depot Inc, 2.375%, 15/03/51	63 648	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
365 000 USD	Home Depot Inc, 3.500%, 15/09/56	288 828	0,11	320 000 USD	Intel Corp, 4.950%, 25/03/60	317 603	0,12
220 000 USD	Host Hotels & Resorts LP, 4.000%, 15/06/25	214 898	0,08	260 000 USD	Intel Corp, 3.200%, 12/08/61	180 336	0,07
25 000 USD	Host Hotels & Resorts LP, 4.500%, 01/02/26	24 538	0,01	250 000 USD	International Business Machines Corp, 3.450%, 19/02/26	243 662	0,09
100 000 USD	Host Hotels & Resorts LP, 2.900%, 15/12/31	84 146	0,03	130 000 USD	International Business Machines Corp, 3.300%, 15/05/26	126 148	0,05
30 000 USD	HP Inc, 2.200%, 17/06/25	28 752	0,01	260 000 USD	International Business Machines Corp, 3.500%, 15/05/29	248 162	0,09
600 000 USD	HP Inc, 1.450%, 17/06/26	552 570	0,20	30 000 USD	International Business Machines Corp, 1.950%, 15/05/30	25 820	0,01
30 000 USD	HP Inc, 3.000%, 17/06/27	28 379	0,01	365 000 USD	International Business Machines Corp, 4.150%, 15/05/39	332 500	0,12
100 000 USD	HP Inc, 4.000%, 15/04/29	97 189	0,04	260 000 USD	International Business Machines Corp, 4.250%, 15/05/49	228 602	0,08
70 000 USD	HP Inc, 6.000%, 15/09/41	74 052	0,03	100 000 USD	International Business Machines Corp, 2.950%, 15/05/50	69 255	0,03
75 000 USD	HSBC Bank USA NA, 7.000%, 15/01/39	87 061	0,03	100 000 USD	International Business Machines Corp, 4.900%, 27/07/52	96 425	0,04
520 000 USD	Hudson Pacific Properties LP, 5.950%, 15/02/28	464 230	0,17	50 000 USD	International Flavors & Fragrances Inc, 4.375%, 01/06/47	38 722	0,01
200 000 USD	Humana Inc, 4.500%, 01/04/25	198 450	0,07	145 000 USD	International Flavors & Fragrances Inc, 5.000%, 26/09/48	124 126	0,05
30 000 USD	Humana Inc, 4.950%, 01/10/44	28 513	0,01	10 000 USD	Interpublic Group of Cos Inc, 4.650%, 01/10/28	9 900	0,00
30 000 USD	Humana Inc, 4.800%, 15/03/47	27 951	0,01	200 000 USD	Interpublic Group of Cos Inc, 4.750%, 30/03/30	196 864	0,07
20 000 USD	Humana Inc, 3.950%, 15/08/49	16 536	0,01	100 000 USD	Interpublic Group of Cos Inc, 2.400%, 01/03/31	84 742	0,03
100 000 USD	Humana Inc, 5.500%, 15/03/53	103 864	0,04	10 000 USD	Interpublic Group of Cos Inc, 5.400%, 01/10/48	9 486	0,00
230 000 USD	Huntington Bancshares Inc, 2.550%, 04/02/30	196 997	0,07	60 000 USD	Interstate Power and Light Co, 4.100%, 26/09/28	58 357	0,02
250 000 USD	Huntsman International LLC, 4.500%, 01/05/29	241 315	0,09	50 000 USD	Interstate Power and Light Co, 3.500%, 30/09/49	37 331	0,01
20 000 USD	IDEX Corp, 3.000%, 01/05/30	17 844	0,01	30 000 USD	Intuit Inc, 0.950%, 15/07/25	28 272	0,01
8 000 USD	Illinois Tool Works Inc, 4.875%, 15/09/41	8 096	0,00	160 000 USD	Intuit Inc, 1.650%, 15/07/30	134 674	0,05
90 000 USD	Illinois Tool Works Inc, 3.900%, 01/09/42	80 809	0,03	420 000 USD	Invitation Homes Operating Partnership LP, 4.150%, 15/04/32	387 601	0,14
390 000 USD	Illumina Inc, 5.800%, 12/12/25	392 812	0,15	10 000 USD	J M Smucker Co, 2.375%, 15/03/30	8 650	0,00
50 000 USD	Illumina Inc, 2.550%, 23/03/31	42 280	0,02	5 000 USD	J M Smucker Co, 4.250%, 15/03/35	4 658	0,00
10 000 USD	Intel Corp, 3.400%, 25/03/25	9 833	0,00	100 000 USD	J M Smucker Co, 3.550%, 15/03/50	73 939	0,03
125 000 USD	Intel Corp, 3.700%, 29/07/25	123 052	0,05	50 000 USD	Jabil Inc, 3.950%, 12/01/28	47 734	0,02
60 000 USD	Intel Corp, 3.750%, 25/03/27	58 860	0,02	30 000 USD	Jabil Inc, 3.000%, 15/01/31	26 059	0,01
20 000 USD	Intel Corp, 3.150%, 11/05/27	19 239	0,01	150 000 USD	JB Hunt Transport Services Inc, 3.875%, 01/03/26	146 820	0,05
150 000 USD	Intel Corp, 4.875%, 10/02/28	152 623	0,06	100 000 USD	John Deere Capital Corp, 1.050%, 17/06/26	92 145	0,03
100 000 USD	Intel Corp, 2.450%, 15/11/29	90 163	0,03	30 000 USD	John Deere Capital Corp, 1.500%, 06/03/28	26 777	0,01
100 000 USD	Intel Corp, 3.900%, 25/03/30	96 985	0,04	280 000 USD	John Deere Capital Corp, 3.450%, 07/03/29	268 909	0,10
100 000 USD	Intel Corp, 4.150%, 05/08/32	97 833	0,04	100 000 USD	John Deere Capital Corp, 4.850%, 11/10/29	102 963	0,04
30 000 USD	Intel Corp, 4.000%, 15/12/32	29 062	0,01				
150 000 USD	Intel Corp, 5.200%, 10/02/33	156 927	0,06				
10 000 USD	Intel Corp, 4.600%, 25/03/40	9 760	0,00				
30 000 USD	Intel Corp, 4.250%, 15/12/42	27 144	0,01				
130 000 USD	Intel Corp, 5.625%, 10/02/43	139 300	0,05				
150 000 USD	Intel Corp, 4.100%, 19/05/46	132 316	0,05				
20 000 USD	Intel Corp, 4.100%, 11/05/47	17 475	0,01				
130 000 USD	Intel Corp, 3.734%, 08/12/47	106 289	0,04				
50 000 USD	Intel Corp, 3.250%, 15/11/49	37 263	0,01				
110 000 USD	Intel Corp, 4.750%, 25/03/50	104 551	0,04				
100 000 USD	Intel Corp, 4.900%, 05/08/52	98 096	0,04				
150 000 USD	Intel Corp, 5.700%, 10/02/53	162 723	0,06				
50 000 USD	Intel Corp, 3.100%, 15/02/60	34 605	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
540 000 USD	John Deere Capital Corp, 4.350%, 15/09/32	540 826	0,20	300 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.493%, 24/03/31	292 908	0,11
100 000 USD	John Deere Capital Corp, 3.400%, perpetual	98 407	0,04	20 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.522%, 22/04/31	17 325	0,01
140 000 USD	John Deere Capital Corp, 3.900%, perpetual	135 323	0,05	10 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.956%, 13/05/31	8 799	0,00
120 000 USD	Johnson & Johnson, 2.625%, 15/01/25	117 437	0,04	185 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.580%, 22/04/32	156 758	0,06
100 000 USD	Johnson & Johnson, 2.450%, 01/03/26	96 193	0,04	190 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.963%, 25/01/33	163 010	0,06
100 000 USD	Johnson & Johnson, 2.950%, 03/03/27	96 658	0,04	970 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.586%, 26/04/33	937 883	0,35
120 000 USD	Johnson & Johnson, 2.900%, 15/01/28	114 959	0,04	830 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 6.254%, 23/10/34	901 272	0,33
130 000 USD	Johnson & Johnson, 3.625%, 03/03/37	119 696	0,04	300 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.882%, 24/07/38	266 649	0,10
100 000 USD	Johnson & Johnson, 5.950%, 15/08/37	115 594	0,04	195 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 5.500%, 15/10/40	203 557	0,08
100 000 USD	Johnson & Johnson, 3.400%, 15/01/38	88 781	0,03	10 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 5.600%, 15/07/41	10 649	0,00
120 000 USD	Johnson & Johnson, 3.700%, 01/03/46	105 126	0,04	130 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.157%, 22/04/42	101 002	0,04
125 000 USD	Johnson & Johnson, 3.750%, 03/03/47	110 285	0,04	440 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.950%, 01/06/45	420 763	0,16
450 000 USD	Johnson & Johnson, 2.450%, 01/09/60	289 678	0,11	20 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.260%, 22/02/48	17 762	0,01
420 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.005%, 13/03/26	403 532	0,15	100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.032%, 24/07/48	85 507	0,03
50 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.300%, 01/04/26	48 369	0,02	230 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.964%, 15/11/48	193 729	0,07
530 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.083%, 22/04/26	507 947	0,19	20 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.897%, 23/01/49	16 667	0,01
105 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.125%, 15/12/26	102 979	0,04	60 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.109%, 22/04/51	43 258	0,02
307 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.960%, 29/01/27	299 967	0,11	115 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.328%, 22/04/52	86 366	0,03
820 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 1.578%, 22/04/27	756 926	0,28	70 000 USD	Kellanova, 3.250%, 01/04/26	67 801	0,02
30 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.250%, 01/10/27	29 705	0,01	40 000 USD	Kellanova, 2.100%, 01/06/30	34 412	0,01
200 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.625%, 01/12/27	191 860	0,07	10 000 USD	Kellanova, 7.450%, 01/04/31	11 465	0,00
305 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.782%, 01/02/28	294 725	0,11	80 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 4.417%, 25/05/25	79 196	0,03
390 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.540%, 01/05/28	372 586	0,14	105 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 4.597%, 25/05/28	105 224	0,04
20 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.509%, 23/01/29	18 954	0,01	100 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 4.050%, 15/04/32	96 176	0,04
100 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.005%, 23/04/29	96 280	0,04	30 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 4.500%, 15/11/45	27 273	0,01
320 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.203%, 23/07/29	311 130	0,11	40 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 5.085%, 25/05/48	39 387	0,01
405 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 4.452%, 05/12/29	396 896	0,15	45 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 3.800%, 01/05/50	36 603	0,01
120 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 3.702%, 06/05/30	112 992	0,04	30 000 USD	Keurig Dr Pepper Inc, 3.350%, 15/03/51	22 372	0,01
160 000 USD	JPMorgan Chase & Co, 2.739%, 15/10/30	142 330	0,05	20 000 USD	KeyBank NA/Cleveland OH, 3.300%, 01/06/25	19 247	0,01
				70 000 USD	KeyBank NA/Cleveland OH, 4.150%, 08/08/25	67 942	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
50 000 USD	KeyBank NA/Cleveland OH, 5.850%, 15/11/27	50 029	0,02	50 000 USD	Leggett & Platt Inc, 4.400%, 15/03/29	48 508	0,02
50 000 USD	KeyBank NA/Cleveland OH, 4.900%, 08/08/32	44 005	0,02	10 000 USD	Lincoln National Corp, 3.050%, 15/01/30	8 846	0,00
100 000 USD	KeyCorp, 2.250%, 06/04/27	90 113	0,03	100 000 USD	Lincoln National Corp, 3.400%, 15/01/31	89 673	0,03
10 000 USD	KeyCorp, 4.100%, 30/04/28	9 422	0,00	20 000 USD	Lincoln National Corp, 4.375%, 15/06/50	15 987	0,01
110 000 USD	KeyCorp, 2.550%, 01/10/29	93 592	0,03	260 000 USD	Lowe's Cos Inc, 4.000%, 15/04/25	256 623	0,09
140 000 USD	Keysight Technologies Inc, 3.000%, 30/10/29	127 469	0,05	100 000 USD	Lowe's Cos Inc, 4.400%, 08/09/25	99 348	0,04
160 000 USD	Kilroy Realty LP, 4.750%, 15/12/28	152 245	0,06	20 000 USD	Lowe's Cos Inc, 3.375%, 15/09/25	19 501	0,01
400 000 USD	Kilroy Realty LP, 4.250%, 15/08/29	368 024	0,14	100 000 USD	Lowe's Cos Inc, 1.300%, 15/04/28	87 975	0,03
140 000 USD	Kilroy Realty LP, 3.050%, 15/02/30	119 263	0,04	200 000 USD	Lowe's Cos Inc, 4.500%, 15/04/30	199 218	0,07
70 000 USD	Kilroy Realty LP, 2.500%, 15/11/32	53 199	0,02	50 000 USD	Lowe's Cos Inc, 3.750%, 01/04/32	46 829	0,02
100 000 USD	Kilroy Realty LP, 2.650%, 15/11/33	76 002	0,03	200 000 USD	Lowe's Cos Inc, 5.000%, 15/04/40	195 552	0,07
220 000 USD	Kimberly-Clark Corp, 3.200%, 25/04/29	208 754	0,08	210 000 USD	Lowe's Cos Inc, 4.050%, 03/05/47	173 504	0,06
10 000 USD	Kimberly-Clark Corp, 2.875%, 07/02/50	7 230	0,00	170 000 USD	Lowe's Cos Inc, 4.550%, 05/04/49	150 588	0,06
20 000 USD	Kimco Realty OP LLC, 3.300%, 01/02/25	19 553	0,01	15 000 USD	Lowe's Cos Inc, 3.000%, 15/10/50	10 221	0,00
50 000 USD	Kimco Realty OP LLC, 1.900%, 01/03/28	44 138	0,02	150 000 USD	Lowe's Cos Inc, 5.850%, 01/04/63 Manufacturers & Traders Trust	158 154	0,06
20 000 USD	Kimco Realty OP LLC, 3.700%, 01/10/49	15 060	0,01	740 000 USD	Co, 4.650%, 27/01/26	724 438	0,27
120 000 USD	KLA Corp, 4.100%, 15/03/29	119 558	0,04	100 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 3.500%, 10/03/25	98 235	0,04
150 000 USD	KLA Corp, 4.950%, 15/07/52	151 657	0,06	195 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 4.375%, 15/03/29	194 392	0,07
100 000 USD	Kroger Co, 3.700%, 01/08/27	96 964	0,04	30 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 2.250%, 15/11/30	25 953	0,01
10 000 USD	Kroger Co, 4.500%, 15/01/29	9 947	0,00	25 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 4.750%, 15/03/39	24 361	0,01
5 000 USD	Kroger Co, 3.875%, 15/10/46	3 949	0,00	65 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 4.900%, 15/03/49	63 051	0,02
180 000 USD	Kroger Co, 4.450%, 01/02/47	159 608	0,06	75 000 USD	Marsh & McLennan Cos Inc, 2.900%, 15/12/51	50 753	0,02
20 000 USD	Kroger Co, 5.400%, 15/01/49	20 090	0,01	100 000 USD	Marvell Technology Inc, 4.875%, 22/06/28	99 718	0,04
100 000 USD	Kroger Co, 3.950%, 15/01/50	81 942	0,03	70 000 USD	Mastercard Inc, 2.000%, 03/03/25	67 853	0,02
170 000 USD	Laboratory Corp of America Holdings, 3.600%, 01/02/25	167 122	0,06	225 000 USD	Mastercard Inc, 3.500%, 26/02/28	219 955	0,08
130 000 USD	Laboratory Corp of America Holdings, 2.700%, 01/06/31	111 879	0,04	80 000 USD	Mastercard Inc, 2.950%, 01/06/29	75 235	0,03
40 000 USD	Laboratory Corp of America Holdings, 4.700%, 01/02/45	36 983	0,01	20 000 USD	Mastercard Inc, 3.350%, 26/03/30	19 089	0,01
10 000 USD	Lam Research Corp, 3.800%, 15/03/25	9 874	0,00	50 000 USD	Mastercard Inc, 1.900%, 15/03/31	42 783	0,02
50 000 USD	Lam Research Corp, 3.750%, 15/03/26	49 121	0,02	10 000 USD	Mastercard Inc, 3.800%, 21/11/46	8 772	0,00
180 000 USD	Lam Research Corp, 4.000%, 15/03/29	177 790	0,07	170 000 USD	Mastercard Inc, 3.650%, 01/06/49	144 352	0,05
45 000 USD	Lam Research Corp, 4.875%, 15/03/49	45 009	0,02	40 000 USD	Mastercard Inc, 2.950%, 15/03/51	29 823	0,01
45 000 USD	Lam Research Corp, 3.125%, 15/06/60	31 338	0,01	30 000 USD	McCormick & Co Inc, 1.850%, 15/02/31	24 705	0,01
470 000 USD	Lazard Group LLC, 3.625%, 01/03/27	443 440	0,16	720 000 USD	McDonald's Corp, 3.700%, 30/01/26	707 976	0,26
20 000 USD	Lazard Group LLC, 4.500%, 19/09/28	19 492	0,01	100 000 USD	McDonald's Corp, 3.500%, 01/07/27	97 313	0,04
110 000 USD	Lear Corp, 3.800%, 15/09/27	106 129	0,04	160 000 USD	McDonald's Corp, 3.600%, 01/07/30	152 043	0,06
50 000 USD	Lear Corp, 5.250%, 15/05/49	46 373	0,02	580 000 USD	McDonald's Corp, 4.700%, 09/12/35	574 235	0,21
50 000 USD	Lear Corp, 3.550%, 15/01/52	35 122	0,01	30 000 USD	McDonald's Corp, 6.300%, 01/03/38	34 179	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 USD	McDonald's Corp, 5.700%, 01/02/39	107 648	0,04	100 000 USD	MidAmerican Energy Co, 3.650%, 15/04/29	95 679	0,04
760 000 USD	McDonald's Corp, 4.875%, 09/12/45	747 574	0,28	100 000 USD	MidAmerican Energy Co, 3.950%, 01/08/47	83 697	0,03
100 000 USD	McDonald's Corp, 4.450%, 01/03/47	91 552	0,03	200 000 USD	MidAmerican Energy Co, 4.250%, 15/07/49	175 436	0,06
20 000 USD	McDonald's Corp, 4.450%, 01/09/48	18 587	0,01	50 000 USD	MidAmerican Energy Co, 3.150%, 15/04/50	36 054	0,01
30 000 USD	McDonald's Corp, 3.625%, 01/09/49	24 184	0,01	80 000 USD	Mohawk Industries Inc, 3.625%, 15/05/30	74 094	0,03
150 000 USD	McDonald's Corp, 5.450%, 14/08/53	160 155	0,06	80 000 USD	Molson Coors Beverage Co, 3.000%, 15/07/26	76 642	0,03
110 000 USD	Mead Johnson Nutrition Co, 4.125%, 15/11/25	108 512	0,04	110 000 USD	Molson Coors Beverage Co, 5.000%, 01/05/42	106 695	0,04
50 000 USD	Medtronic Inc, 4.375%, 15/03/35	48 904	0,02	80 000 USD	Molson Coors Beverage Co, 4.200%, 15/07/46	68 346	0,03
67 000 USD	Medtronic Inc, 4.625%, 15/03/45	65 484	0,02	115 000 USD	Mondelez International Inc, 2.750%, 13/04/30	104 019	0,04
170 000 USD	Merck & Co Inc, 2.750%, 10/02/25	166 238	0,06	10 000 USD	Mondelez International Inc, 1.500%, 04/02/31	8 163	0,00
100 000 USD	Merck & Co Inc, 1.700%, 10/06/27	91 827	0,03	10 000 USD	Mondelez International Inc, 2.625%, 04/09/50	6 725	0,00
360 000 USD	Merck & Co Inc, 3.400%, 07/03/29	345 834	0,13	325 000 USD	Moody's Corp, 3.750%, 24/03/25	319 979	0,12
100 000 USD	Merck & Co Inc, 1.450%, 24/06/30	83 742	0,03	40 000 USD	Moody's Corp, 2.750%, 19/08/41	29 236	0,01
100 000 USD	Merck & Co Inc, 2.150%, 10/12/31	85 485	0,03	20 000 USD	Morgan Stanley, 4.000%, 23/07/25	19 726	0,01
40 000 USD	Merck & Co Inc, 3.900%, 07/03/39	36 441	0,01	585 000 USD	Morgan Stanley, 3.875%, 27/01/26	573 224	0,21
70 000 USD	Merck & Co Inc, 2.350%, 24/06/40	50 984	0,02	450 000 USD	Morgan Stanley, 2.188%, 28/04/26	432 301	0,16
60 000 USD	Merck & Co Inc, 4.150%, 18/05/43	55 358	0,02	920 000 USD	Morgan Stanley, 4.679%, 17/07/26	911 518	0,34
70 000 USD	Merck & Co Inc, 3.700%, 10/02/45	59 674	0,02	50 000 USD	Morgan Stanley, 3.125%, 27/07/26	47 892	0,02
60 000 USD	Merck & Co Inc, 4.000%, 07/03/49	53 191	0,02	15 000 USD	Morgan Stanley, 0.985%, 10/12/26	13 805	0,00
375 000 USD	Merck & Co Inc, 2.900%, 10/12/61	251 569	0,09	20 000 USD	Morgan Stanley, 3.625%, 20/01/27	19 411	0,01
120 000 USD	Meta Platforms Inc, 3.500%, 15/08/27	116 922	0,04	180 000 USD	Morgan Stanley, 3.950%, 23/04/27	174 811	0,06
200 000 USD	Meta Platforms Inc, 4.450%, 15/08/52	184 410	0,07	25 000 USD	Morgan Stanley, 1.593%, 04/05/27	23 037	0,01
350 000 USD	Meta Platforms Inc, 5.600%, 15/05/53	380 625	0,14	300 000 USD	Morgan Stanley, 4.210%, 20/04/28	293 409	0,11
430 000 USD	Meta Platforms Inc, 4.650%, 15/08/62	401 844	0,15	440 000 USD	Morgan Stanley, 3.591%, 22/07/28	419 936	0,16
110 000 USD	MetLife Inc, 4.550%, 23/03/30	110 822	0,04	450 000 USD	Morgan Stanley, 3.772%, 24/01/29	429 453	0,16
25 000 USD	MetLife Inc, 5.700%, 15/06/35	26 917	0,01	425 000 USD	Morgan Stanley, 4.431%, 23/01/30	414 400	0,15
110 000 USD	MetLife Inc, 6.400%, 15/12/36	113 311	0,04	20 000 USD	Morgan Stanley, 2.699%, 22/01/31	17 536	0,01
100 000 USD	MetLife Inc, 4.875%, 13/11/43	97 861	0,04	290 000 USD	Morgan Stanley, 3.622%, 01/04/31	267 273	0,10
250 000 USD	MetLife Inc, 4.600%, 13/05/46	238 477	0,09	100 000 USD	Morgan Stanley, 1.794%, 13/02/32	79 908	0,03
170 000 USD	Micron Technology Inc, 5.327%, 06/02/29	173 561	0,06	300 000 USD	Morgan Stanley, 1.928%, 28/04/32	241 128	0,09
135 000 USD	Microsoft Corp, 3.125%, 03/11/25	131 907	0,05	40 000 USD	Morgan Stanley, 2.239%, 21/07/32	32 650	0,01
110 000 USD	Microsoft Corp, 2.400%, 08/08/26	104 998	0,04	70 000 USD	Morgan Stanley, 2.511%, 20/10/32	58 128	0,02
150 000 USD	Microsoft Corp, 3.300%, 06/02/27	146 251	0,05	140 000 USD	Morgan Stanley, 6.342%, 18/10/33	151 050	0,06
170 000 USD	Microsoft Corp, 3.500%, 12/02/35	161 491	0,06	200 000 USD	Morgan Stanley, 5.250%, 21/04/34	200 064	0,07
100 000 USD	Microsoft Corp, 4.100%, 06/02/37	98 328	0,04	150 000 USD	Morgan Stanley, 2.484%, 16/09/36	119 223	0,04
100 000 USD	Microsoft Corp, 3.700%, 08/08/46	87 906	0,03	295 000 USD	Morgan Stanley, 3.971%, 22/07/38	259 134	0,10
410 000 USD	Microsoft Corp, 4.250%, 06/02/47	397 737	0,15	300 000 USD	Morgan Stanley, 4.457%, 22/04/39	277 509	0,10
247 000 USD	Microsoft Corp, 2.525%, 01/06/50	169 202	0,06	10 000 USD	Morgan Stanley, 4.375%, 22/01/47	9 025	0,00
446 000 USD	Microsoft Corp, 2.921%, 17/03/52	329 108	0,12	215 000 USD	Morgan Stanley, 5.597%, 24/03/51	232 722	0,09
198 000 USD	Microsoft Corp, 2.675%, 01/06/60	133 068	0,05	75 000 USD	Morgan Stanley, 2.802%, 25/01/52	50 178	0,02
50 000 USD	Microsoft Corp, 3.041%, 17/03/62	36 267	0,01	50 000 USD	Mosaic Co, 4.050%, 15/11/27	48 809	0,02
100 000 USD	MidAmerican Energy Co, 3.100%, 01/05/27	95 643	0,04	10 000 USD	Mylan Inc, 4.550%, 15/04/28	9 727	0,00
				10 000 USD	Mylan Inc, 5.400%, 29/11/43	8 698	0,00

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
20 000 USD	Mylan Inc, 5.200%, 15/04/48	16 606	0,01	100 000 USD	Northern States Power Co, 3.200%, 01/04/52	74 162	0,03
15 000 USD	Nasdaq Inc, 3.850%, 30/06/26	14 636	0,01	100 000 USD	Northern States Power Co, 4.500%, 01/06/52	92 516	0,03
190 000 USD	Nasdaq Inc, 2.500%, 21/12/40	132 276	0,05	245 000 USD	Northern Trust Corp, 1.950%, 01/05/30	211 342	0,08
5 000 USD	Nasdaq Inc, 3.250%, 28/04/50	3 543	0,00	30 000 USD	Novartis Capital Corp, 1.750%, 14/02/25	29 042	0,01
100 000 USD	Nasdaq Inc, 5.950%, 15/08/53	107 798	0,04	120 000 USD	Novartis Capital Corp, 3.000%, 20/11/25	116 774	0,04
275 000 USD	NBCUniversal Media LLC, 5.950%, 01/04/41	299 662	0,11	270 000 USD	Novartis Capital Corp, 2.200%, 14/08/30	238 086	0,09
30 000 USD	NetApp Inc, 1.875%, 22/06/25	28 541	0,01	70 000 USD	Novartis Capital Corp, 4.400%, 06/05/44	67 284	0,02
100 000 USD	NetApp Inc, 2.700%, 22/06/30	88 441	0,03	200 000 USD	Novartis Capital Corp, 4.000%, 20/11/45	180 536	0,07
100 000 USD	Netflix Inc, 4.375%, 15/11/26	99 566	0,04	60 000 USD	Novartis Capital Corp, 2.750%, 14/08/50	43 415	0,02
70 000 USD	Netflix Inc, 4.875%, 15/04/28	70 919	0,03	120 000 USD	NSTAR Electric Co, 3.200%, 15/05/27	115 916	0,04
150 000 USD	Netflix Inc, 5.875%, 15/11/28	158 493	0,06	20 000 USD	NSTAR Electric Co, 3.100%, 01/06/51	14 119	0,01
20 000 USD	Newmont Corp, 2.250%, 01/10/30	17 307	0,01	150 000 USD	NVIDIA Corp, 2.850%, 01/04/30	138 925	0,05
130 000 USD	Newmont Corp, 5.875%, 01/04/35	139 950	0,05	100 000 USD	NVIDIA Corp, 3.500%, 01/04/40	87 067	0,03
125 000 USD	Newmont Corp, 6.250%, 01/10/39	138 899	0,05	80 000 USD	NVIDIA Corp, 3.700%, 01/04/60	67 445	0,02
55 000 USD	Newmont Corp, 4.875%, 15/03/42	53 688	0,02	50 000 USD	Omnicom Group Inc, 2.450%, 30/04/30	43 542	0,02
200 000 USD	NextEra Energy Capital Holdings Inc, 1.900%, 15/06/28	177 590	0,07	10 000 USD	Omnicom Group Inc, 4.200%, 01/06/30	9 701	0,00
30 000 USD	NIKE Inc, 2.375%, 01/11/26	28 487	0,01	70 000 USD	Omnicom Group Inc / Omnicom Capital Inc, 3.600%, 15/04/26	68 219	0,03
70 000 USD	NIKE Inc, 2.750%, 27/03/27	66 779	0,02	250 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 4.550%, 15/09/32	248 027	0,09
190 000 USD	NIKE Inc, 3.875%, 01/11/45	168 781	0,06	50 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 4.100%, 15/11/48	43 376	0,02
150 000 USD	NIKE Inc, 3.375%, 27/03/50	122 910	0,05	70 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 3.100%, 15/09/49	50 422	0,02
200 000 USD	NiSource Inc, 5.000%, 15/06/52	187 780	0,07	30 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 2.700%, 15/11/51	19 902	0,01
165 000 USD	Norfolk Southern Corp, 2.900%, 15/06/26	158 336	0,06	50 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 4.600%, 01/06/52	46 718	0,02
130 000 USD	Norfolk Southern Corp, 3.800%, 01/08/28	126 704	0,05	70 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 4.950%, 15/09/52	69 428	0,03
200 000 USD	Norfolk Southern Corp, 3.000%, 15/03/32	178 010	0,07	100 000 USD	Oncor Electric Delivery Co LLC, 5.350%, 01/10/52	103 990	0,04
100 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.450%, 15/06/45	89 565	0,03	30 000 USD	ONE Gas Inc, 2.000%, 15/05/30	25 541	0,01
100 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.650%, 15/01/46	92 383	0,03	10 000 USD	ONE Gas Inc, 4.658%, 01/02/44	9 090	0,00
300 000 USD	Norfolk Southern Corp, 3.942%, 01/11/47	251 058	0,09	70 000 USD	ONEOK Inc, 4.350%, 15/03/29	68 058	0,03
170 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.150%, 28/02/48	146 635	0,05	180 000 USD	ONEOK Inc, 6.350%, 15/01/31	192 425	0,07
40 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.050%, 15/08/52	33 792	0,01	220 000 USD	ONEOK Inc, 6.100%, 15/11/32	233 906	0,09
70 000 USD	Norfolk Southern Corp, 3.700%, 15/03/53	55 614	0,02	200 000 USD	ONEOK Inc, 5.200%, 15/07/48	188 052	0,07
240 000 USD	Norfolk Southern Corp, 3.155%, 15/05/55	168 938	0,06	200 000 USD	ONEOK Inc, 6.625%, 01/09/53	224 702	0,08
200 000 USD	Norfolk Southern Corp, 5.950%, 15/03/64	223 382	0,08	50 000 USD	Oracle Corp, 2.950%, 15/05/25	48 565	0,02
100 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.100%, 15/05/21	75 987	0,03	430 000 USD	Oracle Corp, 2.800%, 01/04/27	405 877	0,15
100 000 USD	Norfolk Southern Corp, 4.550%, perpetual	91 678	0,03	390 000 USD	Oracle Corp, 3.250%, 15/11/27	370 730	0,14
50 000 USD	Northern States Power Co, 2.250%, 01/04/31	42 985	0,02	230 000 USD	Oracle Corp, 2.300%, 25/03/28	209 537	0,08
110 000 USD	Northern States Power Co, 2.900%, 01/03/50	77 340	0,03				
100 000 USD	Northern States Power Co, 2.600%, 01/06/51	65 669	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
270 000 USD	Oracle Corp, 2.950%, 01/04/30	243 910	0,09	200 000 USD	Parker-Hannifin Corp, 4.000%, 14/06/49	175 048	0,06
5 000 USD	Oracle Corp, 3.250%, 15/05/30	4 595	0,00	720 000 USD	PayPal Holdings Inc, 2.650%, 01/10/26	684 209	0,25
10 000 USD	Oracle Corp, 2.875%, 25/03/31	8 866	0,00	100 000 USD	PepsiCo Inc, 2.250%, 19/03/25	97 183	0,04
690 000 USD	Oracle Corp, 6.250%, 09/11/32	751 003	0,28	150 000 USD	PepsiCo Inc, 2.750%, 30/04/25	146 193	0,05
255 000 USD	Oracle Corp, 4.300%, 08/07/34	238 216	0,09	35 000 USD	PepsiCo Inc, 2.375%, 06/10/26	33 277	0,01
405 000 USD	Oracle Corp, 3.900%, 15/05/35	361 082	0,13	20 000 USD	PepsiCo Inc, 7.000%, 01/03/29	22 463	0,01
20 000 USD	Oracle Corp, 3.850%, 15/07/36	17 464	0,01	240 000 USD	PepsiCo Inc, 2.750%, 19/03/30	220 632	0,08
300 000 USD	Oracle Corp, 6.500%, 15/04/38	332 436	0,12	90 000 USD	PepsiCo Inc, 1.950%, 21/10/31	76 453	0,03
310 000 USD	Oracle Corp, 6.125%, 08/07/39	330 475	0,12	200 000 USD	PepsiCo Inc, 3.900%, 18/07/32	195 380	0,07
115 000 USD	Oracle Corp, 5.375%, 15/07/40	113 344	0,04	20 000 USD	PepsiCo Inc, 5.500%, 15/01/40	21 645	0,01
7 000 USD	Oracle Corp, 4.125%, 15/05/45	5 747	0,00	100 000 USD	PepsiCo Inc, 2.625%, 21/10/41	75 544	0,03
20 000 USD	Oracle Corp, 4.000%, 15/11/47	15 859	0,01	200 000 USD	PepsiCo Inc, 3.450%, 06/10/46	165 790	0,06
120 000 USD	Oracle Corp, 3.950%, 25/03/51	94 535	0,03	220 000 USD	PepsiCo Inc, 2.875%, 15/10/49	161 999	0,06
10 000 USD	Oracle Corp, 4.375%, 15/05/55	8 321	0,00	60 000 USD	PepsiCo Inc, 3.875%, 19/03/60	52 193	0,02
40 000 USD	Oracle Corp, 3.850%, 01/04/60	29 189	0,01	310 000 USD	Pfizer Inc, 3.000%, 15/12/26	298 738	0,11
100 000 USD	Oracle Corp, 4.100%, 25/03/61	76 514	0,03	250 000 USD	Pfizer Inc, 3.600%, 15/09/28	243 637	0,09
200 000 USD	Otis Worldwide Corp, 2.056%, 05/04/25	192 386	0,07	30 000 USD	Pfizer Inc, 3.450%, 15/03/29	28 916	0,01
100 000 USD	Otis Worldwide Corp, 2.565%, 15/02/30	89 205	0,03	30 000 USD	Pfizer Inc, 2.625%, 01/04/30	27 075	0,01
100 000 USD	Owens Corning, 3.950%, 15/08/29	95 460	0,04	340 000 USD	Pfizer Inc, 7.200%, 15/03/39	422 447	0,16
60 000 USD	Owens Corning, 3.875%, 01/06/30	56 415	0,02	175 000 USD	Pfizer Inc, 5.600%, 15/09/40	185 643	0,07
20 000 USD	Owens Corning, 4.300%, 15/07/47	17 630	0,01	400 000 USD	Pfizer Inc, 4.400%, 15/05/44	379 312	0,14
120 000 USD	Owens Corning, 4.400%, 30/01/48	104 624	0,04	100 000 USD	Phillips 66, 1.300%, 15/02/26	92 858	0,03
800 000 USD	Pacific Gas and Electric Co, 4.650%, 01/08/28	767 928	0,28	100 000 USD	Phillips 66, 4.650%, 15/11/34	97 282	0,04
850 000 USD	Pacific Gas and Electric Co, 5.900%, 15/06/32	865 614	0,32	250 000 USD	Phillips 66, 4.875%, 15/11/44	240 195	0,09
210 000 USD	Pacific Gas and Electric Co, 6.150%, 15/01/33	217 957	0,08	290 000 USD	Phillips 66, 3.300%, 15/03/52	208 443	0,08
180 000 USD	PacifiCorp, 2.900%, 15/06/52	116 330	0,04	100 000 USD	Phillips 66 Co, 5.300%, 30/06/33	103 016	0,04
100 000 USD	PacifiCorp, 5.350%, 01/12/53	96 425	0,04	100 000 USD	Piedmont Operating Partnership LP, 3.150%, 15/08/30	75 922	0,03
560 000 USD	PacifiCorp, 5.500%, 15/05/54	551 085	0,20	20 000 USD	PNC Bank NA, 3.875%, 10/04/25	19 589	0,01
6 000 USD	Paramount Global, 2.900%, 15/01/27	5 561	0,00	50 000 USD	PNC Bank NA, 4.200%, 01/11/25	49 043	0,02
100 000 USD	Paramount Global, 3.375%, 15/02/28	91 360	0,03	15 000 USD	PNC Bank NA, 3.250%, 22/01/28	14 113	0,01
20 000 USD	Paramount Global, 7.875%, 30/07/30	21 700	0,01	50 000 USD	PNC Bank NA, 2.700%, 22/10/29	43 997	0,02
10 000 USD	Paramount Global, 4.950%, 15/01/31	9 501	0,00	200 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 1.150%, 13/08/26	181 898	0,07
170 000 USD	Paramount Global, 4.200%, 19/05/32	152 141	0,06	150 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 4.758%, 26/01/27	148 857	0,05
200 000 USD	Paramount Global, 4.375%, 15/03/43	148 880	0,05	120 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 3.150%, 19/05/27	113 861	0,04
190 000 USD	Paramount Global, 5.850%, 01/09/43	171 669	0,06	20 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 3.450%, 23/04/29	18 962	0,01
10 000 USD	Paramount Global, 4.950%, 19/05/50	8 133	0,00	300 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 5.582%, 12/06/29	306 297	0,11
10 000 USD	Parker-Hannifin Corp, 3.250%, 01/03/27	9 607	0,00	100 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 2.550%, 22/01/30	87 556	0,03
315 000 USD	Parker-Hannifin Corp, 3.250%, 14/06/29	296 796	0,11	230 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 2.307%, 23/04/32	192 485	0,07
120 000 USD	Parker-Hannifin Corp, 4.450%, 21/11/44	109 271	0,04	100 000 USD	PNC Financial Services Group Inc, 5.939%, 18/08/34	104 150	0,04
				370 000 USD	PPG Industries Inc, 1.200%, 15/03/26	342 183	0,13
				100 000 USD	Principal Financial Group Inc, 3.700%, 15/05/29	94 406	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
10 000 USD	Principal Financial Group Inc, 6.050%, 15/10/36	10 768	0,00	70 000 USD	Prudential Financial Inc, 3.700%, 13/03/51	55 698	0,02
30 000 USD	Procter & Gamble Co, 0.550%, 29/10/25	28 042	0,01	100 000 USD	Public Service Co of Colorado, 4.100%, 15/06/48	81 779	0,03
50 000 USD	Procter & Gamble Co, 1.000%, 23/04/26	46 427	0,02	70 000 USD	Public Service Co of Colorado, 3.200%, 01/03/50	50 114	0,02
10 000 USD	Procter & Gamble Co, 2.450%, 03/11/26	9 554	0,00	50 000 USD	Public Service Co of Colorado, 2.700%, 15/01/51	31 719	0,01
100 000 USD	Procter & Gamble Co, 1.900%, 01/02/27	93 377	0,03	500 000 USD	Public Service Co of New Hampshire, 3.600%, 01/07/49	396 370	0,15
30 000 USD	Procter & Gamble Co, 2.800%, 25/03/27	28 749	0,01	150 000 USD	Public Service Co of Oklahoma, 2.200%, 15/08/31	124 267	0,05
5 000 USD	Procter & Gamble Co, 2.850%, 11/08/27	4 792	0,00	50 000 USD	Public Service Co of Oklahoma, 3.150%, 15/08/51	34 431	0,01
250 000 USD	Procter & Gamble Co, 3.000%, 25/03/30	234 250	0,09	70 000 USD	Public Service Electric and Gas Co, 3.100%, 15/03/32	62 728	0,02
150 000 USD	Procter & Gamble Co, 1.950%, 23/04/31	130 021	0,05	300 000 USD	Public Service Electric and Gas Co, 4.650%, 15/03/33	300 234	0,11
205 000 USD	Procter & Gamble Co, 3.550%, 25/03/40	183 717	0,07	490 000 USD	Qorvo Inc, 4.375%, 15/10/29	467 092	0,17
50 000 USD	Procter & Gamble Co, 3.500%, 25/10/47	42 855	0,02	410 000 USD	Qualcomm Inc, 3.450%, 20/05/25	402 862	0,15
30 000 USD	Procter & Gamble Co, 3.600%, 25/03/50	26 492	0,01	120 000 USD	Qualcomm Inc, 3.250%, 20/05/27	116 219	0,04
110 000 USD	Progressive Corp, 3.200%, 26/03/30	101 905	0,04	20 000 USD	Qualcomm Inc, 2.150%, 20/05/30	17 671	0,01
60 000 USD	Progressive Corp, 4.125%, 15/04/47	53 083	0,02	200 000 USD	Qualcomm Inc, 4.650%, 20/05/35	205 424	0,08
85 000 USD	Progressive Corp, 4.200%, 15/03/48	76 069	0,03	114 000 USD	Qualcomm Inc, 4.800%, 20/05/45	113 506	0,04
100 000 USD	Progressive Corp, 3.950%, 26/03/50	85 112	0,03	100 000 USD	Qualcomm Inc, 4.300%, 20/05/47	91 913	0,03
280 000 USD	Progressive Corp, 2.500%, perpetual	263 088	0,10	30 000 USD	Qualcomm Inc, 3.250%, 20/05/50	23 520	0,01
100 000 USD	Prologis LP, 2.125%, 15/04/27	92 563	0,03	50 000 USD	Quanta Services Inc, 3.050%, 01/10/41	36 745	0,01
100 000 USD	Prologis LP, 2.875%, 15/11/29	90 904	0,03	15 000 USD	Quest Diagnostics Inc, 4.200%, 30/06/29	14 729	0,01
60 000 USD	Prologis LP, 2.250%, 15/04/30	52 590	0,02	130 000 USD	Quest Diagnostics Inc, 2.950%, 30/06/30	116 592	0,04
150 000 USD	Prologis LP, 1.250%, 15/10/30	121 531	0,04	30 000 USD	Ralph Lauren Corp, 3.750%, 15/09/25	29 390	0,01
70 000 USD	Prologis LP, 1.750%, 01/02/31	58 288	0,02	30 000 USD	Ralph Lauren Corp, 2.950%, 15/06/30	27 380	0,01
160 000 USD	Prologis LP, 3.000%, 15/04/50	115 318	0,04	470 000 USD	Regal Rexnord Corp, 6.050%, 15/04/28	476 354	0,18
60 000 USD	Prologis LP, 2.125%, 15/10/50	35 653	0,01	150 000 USD	Regal Rexnord Corp, 6.400%, 15/04/33	156 778	0,06
50 000 USD	Prudential Financial Inc, 1.500%, 10/03/26	46 659	0,02	100 000 USD	Regency Centers LP, 3.700%, 15/06/30	93 103	0,03
50 000 USD	Prudential Financial Inc, 5.700%, 14/12/36	54 199	0,02	335 000 USD	Regeneron Pharmaceuticals Inc, 1.750%, 15/09/30	275 755	0,10
70 000 USD	Prudential Financial Inc, 3.000%, 10/03/40	54 577	0,02	10 000 USD	Regeneron Pharmaceuticals Inc, 2.800%, perpetual	6 625	0,00
185 000 USD	Prudential Financial Inc, 4.600%, 15/05/44	172 770	0,06	30 000 USD	Regions Financial Corp, 2.250%, 18/05/25	28 594	0,01
20 000 USD	Prudential Financial Inc, 5.375%, 15/05/45	19 762	0,01	10 000 USD	Reinsurance Group of America Inc, 3.900%, 15/05/29	9 530	0,00
70 000 USD	Prudential Financial Inc, 3.905%, 07/12/47	57 586	0,02	30 000 USD	RELX Capital Inc, 4.000%, 18/03/29	29 467	0,01
10 000 USD	Prudential Financial Inc, 5.700%, 15/09/48	9 727	0,00	390 000 USD	Retail Opportunity Investments Partnership LP, 6.750%, 15/10/28	410 440	0,15
90 000 USD	Prudential Financial Inc, 3.700%, 01/10/50	77 961	0,03	50 000 USD	Revvity Inc, 3.300%, 15/09/29	45 428	0,02
				300 000 USD	Revvity Inc, 2.250%, 15/09/31	247 113	0,09

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
80 000 USD	Rockwell Automation Inc, 4.200%, 01/03/49	72 197	0,03	510 000 USD	Southern California Edison Co, 4.200%, 01/03/29	500 483	0,19
220 000 USD	Ryder System Inc, 4.625%, 01/06/25	218 442	0,08	100 000 USD	Southern California Edison Co, 6.650%, 01/04/29	106 660	0,04
150 000 USD	Ryder System Inc, 6.300%, 01/12/28	159 118	0,06	20 000 USD	Southern California Edison Co, 6.000%, 15/01/34	21 970	0,01
360 000 USD	Ryder System Inc, 6.600%, 01/12/33	399 870	0,15	210 000 USD	Southern California Edison Co, 6.050%, 15/03/39	222 648	0,08
150 000 USD	S&P Global Inc, 2.450%, 01/03/27	141 549	0,05	150 000 USD	Southern California Edison Co, 4.875%, 01/03/49	138 871	0,05
170 000 USD	S&P Global Inc, 2.500%, 01/12/29	153 452	0,06	150 000 USD	Southern California Edison Co, 5.875%, 01/12/53	162 447	0,06
150 000 USD	S&P Global Inc, 3.700%, 01/03/52	125 064	0,05	550 000 USD	Southern California Gas Co, 3.950%, 15/02/50	439 334	0,16
110 000 USD	S&P Global Inc, 2.300%, 15/08/60	66 356	0,02	200 000 USD	Southern California Gas Co, 6.350%, 15/11/52	229 992	0,08
200 000 USD	Sabine Pass Liquefaction LLC, 4.500%, 15/05/30	195 908	0,07	100 000 USD	Southern Copper Corp, 6.750%, 16/04/40	111 984	0,04
130 000 USD	Salesforce Inc, 3.700%, 11/04/28	127 484	0,05	100 000 USD	Southern Copper Corp, 5.875%, 23/04/45	101 553	0,04
50 000 USD	Salesforce Inc, 2.700%, 15/07/41	38 284	0,01	170 000 USD	Southern Power Co, 0.900%, 15/01/26	156 726	0,06
100 000 USD	Salesforce Inc, 2.900%, 15/07/51	71 804	0,03	150 000 USD	Southwest Gas Corp, 5.800%, 01/12/27	154 582	0,06
90 000 USD	Salesforce Inc, 3.050%, 15/07/61	63 431	0,02	80 000 USD	Southwest Gas Corp, 2.200%, 15/06/30	68 021	0,02
110 000 USD	Santander Holdings USA Inc, 3.450%, 02/06/25	106 868	0,04	70 000 USD	Southwest Gas Corp, 4.150%, 01/06/49	55 150	0,02
20 000 USD	Santander Holdings USA Inc, 4.400%, 13/07/27	19 444	0,01	200 000 USD	Southwestern Electric Power Co, 3.250%, perpetual	135 400	0,05
100 000 USD	Santander Holdings USA Inc, 2.490%, 06/01/28	91 731	0,03	50 000 USD	Spire Missouri Inc, 3.300%, 01/06/51	35 556	0,01
500 000 USD	Santander Holdings USA Inc, 6.565%, 12/06/29	516 470	0,19	270 000 USD	Sprint LLC, 7.625%, 15/02/25	274 787	0,10
140 000 USD	Santander Holdings USA Inc, 7.660%, 09/11/31	151 747	0,06	100 000 USD	Stanley Black & Decker Inc, 3.400%, 01/03/26	96 724	0,04
100 000 USD	Sempra, 3.300%, 01/04/25	97 556	0,04	670 000 USD	Stanley Black & Decker Inc, 2.300%, 15/03/30	570 894	0,21
330 000 USD	Sempra, 3.800%, 01/02/38	283 140	0,10	20 000 USD	Starbucks Corp, 3.800%, 15/08/25	19 643	0,01
170 000 USD	Sherwin-Williams Co, 3.450%, 01/06/27	164 308	0,06	15 000 USD	Starbucks Corp, 3.500%, 01/03/28	14 441	0,01
170 000 USD	Sherwin-Williams Co, 4.500%, 01/06/47	155 881	0,06	220 000 USD	Starbucks Corp, 4.000%, 15/11/28	216 891	0,08
290 000 USD	Simon Property Group LP, 3.300%, 15/01/26	281 285	0,10	15 000 USD	Starbucks Corp, 2.250%, 12/03/30	13 183	0,00
20 000 USD	Simon Property Group LP, 3.250%, 30/11/26	19 225	0,01	420 000 USD	Starbucks Corp, 2.550%, 15/11/30	371 851	0,14
340 000 USD	Simon Property Group LP, 3.375%, 01/12/27	324 873	0,12	50 000 USD	Starbucks Corp, 3.750%, 01/12/47	40 397	0,01
30 000 USD	Simon Property Group LP, 2.200%, 01/02/31	25 181	0,01	150 000 USD	Starbucks Corp, 4.450%, 15/08/49	136 974	0,05
10 000 USD	Simon Property Group LP, 6.750%, 01/02/40	11 355	0,00	40 000 USD	Stryker Corp, 1.150%, 15/06/25	37 846	0,01
110 000 USD	Simon Property Group LP, 3.250%, 13/09/49	79 879	0,03	140 000 USD	Stryker Corp, 3.375%, 01/11/25	136 298	0,05
190 000 USD	Skyworks Solutions Inc, 3.000%, 01/06/31	163 402	0,06	125 000 USD	Stryker Corp, 3.500%, 15/03/26	121 951	0,04
100 000 USD	Sonoco Products Co, 1.800%, 01/02/25	96 196	0,04	200 000 USD	Stryker Corp, 3.650%, 07/03/28	193 754	0,07
50 000 USD	Sonoco Products Co, 3.125%, 01/05/30	45 125	0,02	30 000 USD	Stryker Corp, 1.950%, 15/06/30	25 696	0,01
100 000 USD	Sonoco Products Co, 2.850%, 01/02/32	85 446	0,03	30 000 USD	Stryker Corp, 4.375%, 15/05/44	27 529	0,01
100 000 USD	Southern California Edison Co, 3.650%, 01/03/28	95 939	0,04	50 000 USD	Stryker Corp, 4.625%, 15/03/46	48 406	0,02
				770 000 USD	Sysco Corp, 5.950%, 01/04/30	820 504	0,30
				200 000 USD	Sysco Corp, 6.600%, 01/04/50	234 946	0,09
				175 000 USD	Tapestry Inc, 4.125%, 15/07/27	166 733	0,06
				260 000 USD	Tapestry Inc, 7.350%, 27/11/28	273 117	0,10
				360 000 USD	Tapestry Inc, 3.050%, 15/03/32	292 385	0,11

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
200 000 USD	Target Corp, 2.250%, 15/04/25	193 938	0,07	100 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 1.450%, 13/01/25	96 525	0,04
220 000 USD	Target Corp, 3.375%, 15/04/29	211 928	0,08	230 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 3.000%, 01/04/25	224 919	0,08
50 000 USD	Target Corp, 2.350%, 15/02/30	44 770	0,02	200 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 3.400%, 14/04/25	196 344	0,07
90 000 USD	Target Corp, 4.000%, 01/07/42	81 810	0,03	110 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 0.800%, 16/10/25	102 881	0,04
20 000 USD	Target Corp, 3.625%, 15/04/46	16 606	0,01	200 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 4.450%, 18/05/26	199 764	0,07
100 000 USD	Target Corp, 4.800%, 15/01/53	99 487	0,04	100 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 3.200%, 11/01/27	96 505	0,04
540 000 USD	TD SYNEX Corp, 2.650%, 09/08/31	437 665	0,16	100 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 3.050%, 22/03/27	95 892	0,04
130 000 USD	Texas Instruments Inc, 1.375%, 12/03/25	125 081	0,05	60 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 1.150%, 13/08/27	53 665	0,02
10 000 USD	Texas Instruments Inc, 2.250%, 04/09/29	9 030	0,00	150 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 1.900%, 06/04/28	136 270	0,05
190 000 USD	Texas Instruments Inc, 3.875%, 15/03/39	176 130	0,07	250 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 2.150%, 13/02/30	221 040	0,08
55 000 USD	Texas Instruments Inc, 4.150%, 15/05/48	50 113	0,02	70 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 3.375%, 01/04/30	65 891	0,02
380 000 USD	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.750%, 15/10/28	339 226	0,13	60 000 USD	Toyota Motor Credit Corp, 1.650%, 10/01/31	50 003	0,02
50 000 USD	Thermo Fisher Scientific Inc, 2.800%, 15/10/41	38 039	0,01	275 000 USD	Tractor Supply Co, 1.750%, 01/11/30	225 827	0,08
110 000 USD	Thermo Fisher Scientific Inc, 5.300%, 01/02/44	114 726	0,04	10 000 USD	Trane Technologies Global Holding Co Ltd, 5.750%, 15/06/43	10 769	0,00
60 000 USD	Thermo Fisher Scientific Inc, 4.100%, 15/08/47	53 689	0,02	70 000 USD	Travelers Cos Inc, 5.350%, 01/11/40	73 308	0,03
100 000 USD	Time Warner Cable LLC, 6.550%, 01/05/37	98 569	0,04	80 000 USD	Travelers Cos Inc, 3.750%, 15/05/46	66 182	0,02
70 000 USD	Time Warner Cable LLC, 6.750%, 15/06/39	69 836	0,03	170 000 USD	Travelers Cos Inc, 2.550%, 27/04/50	112 659	0,04
240 000 USD	Timken Co, 4.125%, 01/04/32	221 023	0,08	10 000 USD	Travelers Property Casualty Corp, 6.375%, 15/03/33	11 459	0,00
30 000 USD	TJX Cos Inc, 1.150%, 15/05/28	26 189	0,01	20 000 USD	Truist Bank, 1.500%, 10/03/25	19 106	0,01
90 000 USD	TJX Cos Inc, 3.875%, 15/04/30	86 784	0,03	50 000 USD	Truist Bank, 3.625%, 16/09/25	48 388	0,02
295 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.500%, 15/04/25	288 902	0,11	400 000 USD	Truist Bank, 2.250%, 11/03/30	331 592	0,12
290 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.750%, 15/04/27	281 399	0,10	250 000 USD	Truist Financial Corp, 4.000%, 01/05/25	245 687	0,09
500 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.875%, 15/04/30	474 385	0,18	60 000 USD	Truist Financial Corp, 3.700%, 05/06/25	58 684	0,02
100 000 USD	T-Mobile USA Inc, 2.550%, 15/02/31	86 197	0,03	110 000 USD	Truist Financial Corp, 1.267%, 02/03/27	100 823	0,04
580 000 USD	T-Mobile USA Inc, 2.250%, 15/11/31	483 099	0,18	300 000 USD	Truist Financial Corp, 4.916%, 28/07/33	281 001	0,10
50 000 USD	T-Mobile USA Inc, 4.375%, 15/04/40	45 304	0,02	100 000 USD	Truist Financial Corp, 1.887%, perpetual	86 541	0,03
100 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.000%, 15/02/41	75 045	0,03	250 000 USD	TSMC Arizona Corp, 2.500%, 25/10/31	214 482	0,08
175 000 USD	T-Mobile USA Inc, 4.500%, 15/04/50	155 141	0,06	200 000 USD	TSMC Arizona Corp, 4.250%, 22/04/32	196 536	0,07
250 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.300%, 15/02/51	181 540	0,07	200 000 USD	TSMC Arizona Corp, 3.125%, 25/10/41	162 238	0,06
50 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.400%, 15/10/52	36 578	0,01	50 000 USD	TSMC Arizona Corp, 3.250%, 25/10/51	39 404	0,01
150 000 USD	T-Mobile USA Inc, 5.650%, 15/01/53	156 691	0,06				
100 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.600%, 15/11/60	72 801	0,03				
300 000 USD	T-Mobile USA Inc, 3.375%, perpetual	279 174	0,10				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
70 000 USD	Tucson Electric Power Co, 1.500%, 01/08/30	57 185	0,02	20 000 USD	United Parcel Service Inc, 3.050%, 15/11/27	19 164	0,01
220 000 USD	TWDC Enterprises 18 Corp, 2.950%, 15/06/27	211 207	0,08	130 000 USD	United Parcel Service Inc, 3.400%, 15/03/29	125 930	0,05
120 000 USD	UDR Inc, 1.900%, 15/03/33	92 035	0,03	130 000 USD	United Parcel Service Inc, 6.200%, 15/01/38	149 209	0,06
50 000 USD	Unilever Capital Corp, 3.100%, 30/07/25	48 942	0,02	20 000 USD	United Parcel Service Inc, 4.875%, 15/11/40	20 113	0,01
220 000 USD	Unilever Capital Corp, 3.500%, 22/03/28	213 594	0,08	10 000 USD	United Parcel Service Inc, 3.750%, 15/11/47	8 497	0,00
65 000 USD	Union Electric Co, 2.625%, 15/03/51	41 623	0,02	130 000 USD	United Parcel Service Inc, 4.250%, 15/03/49	118 622	0,04
330 000 USD	Union Pacific Corp, 3.750%, 15/07/25	320 665	0,12	160 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.750%, 15/07/25	157 763	0,06
20 000 USD	Union Pacific Corp, 3.250%, 15/08/25	19 553	0,01	10 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 1.150%, 15/05/26	9 267	0,00
70 000 USD	Union Pacific Corp, 2.150%, 05/02/27	65 458	0,02	20 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.450%, 15/01/27	19 496	0,01
425 000 USD	Union Pacific Corp, 3.950%, 10/09/28	422 556	0,16	150 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.850%, 15/06/28	147 039	0,05
200 000 USD	Union Pacific Corp, 3.700%, 01/03/29	195 626	0,07	385 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 2.000%, 15/05/30	333 198	0,12
200 000 USD	Union Pacific Corp, 2.800%, 14/02/32	177 580	0,07	100 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 2.300%, 15/05/31	86 688	0,03
830 000 USD	Union Pacific Corp, 2.891%, 06/04/36	698 943	0,26	305 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.625%, 15/07/35	307 596	0,11
15 000 USD	Union Pacific Corp, 3.600%, 15/09/37	13 375	0,00	20 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 5.800%, 15/03/36	21 933	0,01
100 000 USD	Union Pacific Corp, 3.200%, 20/05/41	80 276	0,03	10 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 6.625%, 15/11/37	11 775	0,00
12 000 USD	Union Pacific Corp, 4.000%, 15/04/47	10 180	0,00	125 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 6.875%, 15/02/38	151 405	0,06
100 000 USD	Union Pacific Corp, 4.500%, 10/09/48	91 898	0,03	225 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.500%, 15/08/39	191 749	0,07
225 000 USD	Union Pacific Corp, 4.300%, 01/03/49	200 423	0,07	920 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 2.750%, 15/05/40	696 734	0,26
100 000 USD	Union Pacific Corp, 3.250%, 05/02/50	76 648	0,03	50 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.750%, 15/07/45	48 771	0,02
100 000 USD	Union Pacific Corp, 3.799%, 01/10/51	84 096	0,03	130 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.250%, 15/04/47	116 527	0,04
100 000 USD	Union Pacific Corp, 3.875%, 01/02/55	82 199	0,03	100 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 4.250%, 15/06/48	89 681	0,03
100 000 USD	Union Pacific Corp, 3.950%, 15/08/59	82 240	0,03	100 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 2.900%, 15/05/50	70 438	0,03
80 000 USD	Union Pacific Corp, 3.839%, 20/03/60	65 442	0,02	60 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.250%, 15/05/51	45 444	0,02
100 000 USD	Union Pacific Corp, 3.550%, 20/05/61	75 684	0,03	50 000 USD	UnitedHealth Group Inc, 3.125%, 15/05/60	35 554	0,01
150 000 USD	Union Pacific Corp, 5.150%, 20/01/63	152 862	0,06	40 000 USD	Unum Group, 4.500%, 15/12/49	31 732	0,01
150 000 USD	Union Pacific Corp, 3.799%, 06/04/71	119 068	0,04	195 000 USD	Unum Group, 4.125%, 15/06/51	146 152	0,05
150 000 USD	Union Pacific Corp, 3.850%, 14/02/72	119 491	0,04	70 000 USD	US Bancorp, 1.450%, 12/05/25	66 704	0,02
70 000 USD	Union Pacific Corp, 2.973%, perpetual	47 271	0,02	20 000 USD	US Bancorp, 3.100%, 27/04/26	19 181	0,01
150 000 USD	United Parcel Service Inc, 3.900%, 01/04/25	148 342	0,05	100 000 USD	US Bancorp, 3.150%, 27/04/27	95 191	0,04
				15 000 USD	US Bancorp, 3.900%, 26/04/28	14 518	0,01
				130 000 USD	US Bancorp, 4.653%, 01/02/29	127 964	0,05
				200 000 USD	US Bancorp, 5.775%, 12/06/29	205 452	0,08
				100 000 USD	US Bancorp, 3.000%, 30/07/29	90 663	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
360 000 USD	US Bancorp, 5.850%, 21/10/33	371 956	0,14	475 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.700%, 22/03/61	363 128	0,13
120 000 USD	US Bancorp, 4.839%, 01/02/34	115 254	0,04	20 000 USD	VF Corp, 2.400%, 23/04/25	19 105	0,01
150 000 USD	US Bancorp, 5.836%, 12/06/34	155 031	0,06	270 000 USD	Viatis Inc, 1.650%, 22/06/25	255 685	0,09
80 000 USD	US Bancorp, 2.491%, 03/11/36	62 705	0,02	270 000 USD	Viatis Inc, 2.300%, 22/06/27	245 219	0,09
50 000 USD	US Bank NA, 2.050%, 21/01/25	48 360	0,02	170 000 USD	Viatis Inc, 4.000%, 22/06/50	119 930	0,04
250 000 USD	US Bank NA, 2.800%, 27/01/25	243 067	0,09	175 000 USD	Visa Inc, 3.150%, 14/12/25	170 849	0,06
30 000 USD	Ventas Realty LP, 4.125%, 15/01/26	29 291	0,01	30 000 USD	Visa Inc, 1.900%, 15/04/27	27 936	0,01
210 000 USD	Ventas Realty LP, 4.400%, 15/01/29	204 387	0,08	130 000 USD	Visa Inc, 2.050%, 15/04/30	114 442	0,04
125 000 USD	Ventas Realty LP, 5.700%, 30/09/43	120 670	0,04	100 000 USD	Visa Inc, 4.150%, 14/12/35	97 963	0,04
70 000 USD	Verisk Analytics Inc, 4.125%, 15/03/29	68 209	0,03	200 000 USD	Visa Inc, 4.300%, 14/12/45	186 934	0,07
200 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.376%, 15/02/25	196 322	0,07	540 000 USD	Visa Inc, 3.650%, 15/09/47	456 554	0,17
30 000 USD	Verizon Communications Inc, 0.850%, 20/11/25	27 865	0,01	100 000 USD	VMware Inc, 4.650%, 15/05/27	99 247	0,04
10 000 USD	Verizon Communications Inc, 1.450%, 20/03/26	9 314	0,00	20 000 USD	VMware Inc, 3.900%, 21/08/27	19 375	0,01
195 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.625%, 15/08/26	185 851	0,07	15 000 USD	VMware Inc, 4.700%, 15/05/30	14 819	0,01
30 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.125%, 16/03/27	29 592	0,01	260 000 USD	VMware Inc, 2.200%, 15/08/31	215 730	0,08
120 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.000%, 22/03/27	114 199	0,04	520 000 USD	Vontier Corp, 2.400%, 01/04/28	458 749	0,17
30 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.329%, 21/09/28	29 718	0,01	70 000 USD	Vornado Realty LP, 3.400%, 01/06/31	54 251	0,02
200 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.875%, 08/02/29	194 116	0,07	50 000 USD	Voya Financial Inc, 3.650%, 15/06/26	48 361	0,02
450 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.016%, 03/12/29	435 478	0,16	70 000 USD	Vulcan Materials Co, 3.500%, 01/06/30	65 204	0,02
100 000 USD	Verizon Communications Inc, 1.500%, 18/09/30	82 538	0,03	30 000 USD	Vulcan Materials Co, 4.500%, 15/06/47	27 179	0,01
170 000 USD	Verizon Communications Inc, 1.750%, 20/01/31	139 754	0,05	70 000 USD	Vulcan Materials Co, 4.700%, 01/03/48	65 498	0,02
235 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.550%, 21/03/31	202 819	0,07	120 000 USD	Walgreens Boots Alliance Inc, 3.450%, 01/06/26	114 084	0,04
1 010 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.355%, 15/03/32	840 875	0,31	80 000 USD	Walgreens Boots Alliance Inc, 4.800%, 18/11/44	66 698	0,02
40 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.272%, 15/01/36	37 733	0,01	20 000 USD	Walgreens Boots Alliance Inc, 4.100%, 15/04/50	14 545	0,01
100 000 USD	Verizon Communications Inc, 5.250%, 16/03/37	104 024	0,04	40 000 USD	Walt Disney Co, 3.350%, 24/03/25	39 256	0,01
170 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.400%, 22/03/41	135 849	0,05	120 000 USD	Walt Disney Co, 3.700%, 15/10/25	117 940	0,04
200 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.850%, 03/09/41	148 290	0,05	100 000 USD	Walt Disney Co, 1.750%, 13/01/26	94 659	0,03
150 000 USD	Verizon Communications Inc, 4.862%, 21/08/46	143 443	0,05	20 000 USD	Walt Disney Co, 2.000%, 01/09/29	17 764	0,01
165 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.550%, 22/03/51	127 210	0,05	180 000 USD	Walt Disney Co, 6.550%, 15/03/33	208 643	0,08
250 000 USD	Verizon Communications Inc, 2.987%, 30/10/56	166 157	0,06	369 000 USD	Walt Disney Co, 6.400%, 15/12/35	423 184	0,16
174 000 USD	Verizon Communications Inc, 3.000%, 20/11/60	114 172	0,04	290 000 USD	Walt Disney Co, 6.650%, 15/11/37	341 417	0,13
				150 000 USD	Walt Disney Co, 6.150%, 15/02/41	168 699	0,06
				150 000 USD	Walt Disney Co, 7.750%, 01/12/45	200 871	0,07
				13 000 USD	Walt Disney Co, 2.750%, 01/09/49	8 948	0,00
				30 000 USD	Walt Disney Co, 4.700%, 23/03/50	29 196	0,01
				130 000 USD	Walt Disney Co, 3.600%, 13/01/51	104 839	0,04
				15 000 USD	Walt Disney Co, 3.800%, 13/05/60	12 231	0,00
				200 000 USD	Warnermedia Holdings Inc, 3.638%, 15/03/25	195 782	0,07
				100 000 USD	Warnermedia Holdings Inc, 3.788%, 15/03/25	97 936	0,04
				200 000 USD	Warnermedia Holdings Inc, 3.755%, 15/03/27	191 804	0,07
				200 000 USD	Warnermedia Holdings Inc, 4.279%, 15/03/32	183 214	0,07

Tableau des investissements (suite)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,43 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
300 000 USD	Warnernedia Holdings Inc, 5.050%, 15/03/42	264 843	0,10	10 000 USD	Weyerhaeuser Co, 7.375%, 15/03/32	11 628	0,00
350 000 USD	Warnernedia Holdings Inc, 5.141%, 15/03/52	301 763	0,11	150 000 USD	Whirlpool Corp, 4.750%, 26/02/29	149 508	0,06
150 000 USD	Warnernedia Holdings Inc, 5.391%, 15/03/62	129 274	0,05	125 000 USD	Whirlpool Corp, 4.600%, 15/05/50	105 736	0,04
30 000 USD	Welltower OP LLC, 4.000%, 01/06/25	29 466	0,01	70 000 USD	WW Grainger Inc, 4.600%, 15/06/45	67 678	0,02
100 000 USD	Welltower OP LLC, 2.700%, 15/02/27	94 024	0,03	50 000 USD	WW Grainger Inc, 4.200%, 15/05/47	45 205	0,02
280 000 USD	Welltower OP LLC, 4.250%, 15/04/28	274 893	0,10	100 000 USD	Xilinx Inc, 2.375%, 01/06/30	88 727	0,03
15 000 USD	Welltower OP LLC, 3.100%, 15/01/30	13 556	0,00	100 000 USD	Xylem Inc, 1.950%, 30/01/28	90 539	0,03
175 000 USD	Welltower OP LLC, 4.950%, 01/09/48	166 152	0,06	130 000 USD	Xylem Inc, 2.250%, 30/01/31	111 500	0,04
250 000 USD	Westinghouse Air Brake Technologies Corp, 3.200%, 15/06/25	241 940	0,09	150 000 USD	Zimmer Biomet Holdings Inc, 3.550%, 01/04/25	146 926	0,05
80 000 USD	Weyerhaeuser Co, 4.000%, 15/11/29	76 508	0,03				
				États-Unis – Total		223 993 915	82,90
				Total des obligations d'entreprise		265 961 001	98,43
				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé		265 961 001	98,43
				TOTAL DES INVESTISSEMENTS		265 961 001	98,43

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – 0,27 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	28 665 388	31 456 875	209 562	0,08
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	3 241 479	3 542 000	38 837	0,01
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	26 145 295	28 735 875	146 634	0,05
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	26 144 462	28 735 875	145 714	0,05
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	Morgan Stanley And Co International	2 859 094	3 122 000	36 419	0,01
Bought EUR / Sold USD, due 04/01/24	UBS AG	26 145 318	28 735 875	146 660	0,06
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	31 082 125	28 119 688	18 519	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	BNP Paribas SA	31 082 125	28 114 168	24 616	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Goldman Sachs International	31 082 125	28 110 812	28 324	0,01
Bought USD / Sold EUR, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	31 082 125	28 115 898	22 706	0,01
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				817 991	0,30

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,27 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Barclays Bank PLC	28 083 280	31 082 125	(19 935)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	BNP Paribas SA	28 078 003	31 082 125	(25 772)	(0,01)
	Goldman Sachs				
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	International	28 074 630	31 082 125	(29 502)	(0,01)
Bought EUR / Sold USD, due 05/02/24	Royal Bank of Canada	28 079 703	31 082 125	(23 892)	(0,01)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(99 101)	(0,03)
Total des contrats de change à terme – couverture				718 890	0,27
Autres actifs/(passifs) nets				3 508 649	1,30
TOTAL DES ACTIFS NETS				270 188 540	100,00

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 98,65 %				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				
Australie				Autriche (suite)				
200 000 EUR	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 0.625%, 25/08/30	168 536	0,06	200 000 EUR	Erste Group Bank AG, 4.000%, 16/01/31	206 978	0,07	
280 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0.750%, 29/09/26	262 816	0,10	300 000 EUR	Erste Group Bank AG, 1.625%, 08/09/31	279 918	0,10	
100 000 EUR	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 0.669%, 05/05/31	91 626	0,03	100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 4.000%, 07/06/33	98 332	0,04	
100 000 EUR	Commonwealth Bank of Australia, 1.125%, 18/01/28	93 793	0,03	300 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 4.125%, 08/09/25	301 677	0,11	
140 000 EUR	Goodman Australia Finance Pty Ltd, 1.375%, 27/09/25	135 316	0,05	400 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.375%, 25/09/26	365 768	0,13	
200 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.350%, 03/03/28	176 914	0,06	300 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 2.875%, 18/06/32	268 827	0,10	
240 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.943%, 19/01/29	210 845	0,08	200 000 EUR	Raiffeisen Bank International AG, 1.375%, 17/06/33	163 526	0,06	
100 000 EUR	Macquarie Group Ltd, 0.950%, 21/05/31	82 942	0,03	100 000 EUR	Telekom Finanzmanagement GmbH, 1.500%, 07/12/26	96 335	0,04	
400 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 2.125%, 24/05/28	386 252	0,14	Autriche – Total			2 528 265	0,91
220 000 EUR	National Australia Bank Ltd, 1.375%, 30/08/28	203 403	0,07	Belgique				
320 000 EUR	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2, 1.450%, 28/03/29	281 917	0,10	100 000 EUR	Aedifica SA, 0.750%, 09/09/31	79 547	0,03	
100 000 EUR	Sydney Airport Finance Co Pty Ltd, 1.750%, 26/04/28	94 078	0,03	100 000 EUR	Ageas SA/NV, 1.875%, 24/11/51	80 019	0,03	
100 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.125%, 14/04/26	95 868	0,04	190 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.150%, 22/01/27	180 472	0,07	
100 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.375%, 26/03/29	92 391	0,03	120 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.125%, 01/07/27	113 297	0,04	
100 000 EUR	Telstra Group Ltd, 1.000%, 23/04/30	89 081	0,03	100 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.125%, 02/12/27	97 389	0,03	
120 000 EUR	Toyota Finance Australia Ltd, 2.280%, 21/10/27	117 014	0,04	310 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.000%, 17/03/28	301 180	0,11	
100 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 2.000%, 28/08/25	97 703	0,04	360 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1.500%, 18/04/30	331 078	0,12	
100 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 1.450%, 16/05/29	91 092	0,03	380 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.875%, 02/04/32	375 949	0,14	
100 000 EUR	Transurban Finance Co Pty Ltd, 3.000%, 08/04/30	97 840	0,04	470 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2.750%, 17/03/36	447 938	0,16	
230 000 EUR	Westpac Banking Corp, 0.875%, 17/04/27	213 429	0,08	170 000 EUR	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3.700%, 02/04/40	173 706	0,06	
200 000 EUR	Westpac Banking Corp, 1.125%, 05/09/27	185 974	0,07	200 000 EUR	Argenta Spaarbank NV, 1.375%, 08/02/29	177 680	0,06	
260 000 EUR	Westpac Banking Corp, 0.766%, 13/05/31	238 326	0,09	100 000 EUR	Elia Transmission Belgium SA, 3.625%, 18/01/33	103 207	0,04	
Australie – Total			3 507 156	1,27	100 000 EUR	Groupe Bruxelles Lambert NV, 3.125%, 06/09/29	100 293	0,04
Autriche				100 000 EUR	KBC Group NV, 4.500%, 06/06/26	101 083	0,04	
400 000 EUR	CA Immobilien Anlagen AG, 1.000%, 27/10/25	365 972	0,13	300 000 EUR	KBC Group NV, 0.125%, 10/09/26	282 891	0,10	
100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.050%, 16/09/25	94 520	0,03	300 000 EUR	KBC Group NV, 0.250%, 01/03/27	280 578	0,10	
100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 0.100%, 16/11/28	88 287	0,03	200 000 EUR	KBC Group NV, 0.375%, 16/06/27	186 300	0,07	
100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 4.250%, 30/05/30	103 786	0,04	300 000 EUR	KBC Group NV, 4.375%, 23/11/27	307 047	0,11	
100 000 EUR	Erste Group Bank AG, 1.000%, 10/06/30	94 339	0,03	100 000 EUR	KBC Group NV, 0.750%, 21/01/28	92 016	0,03	
				100 000 EUR	KBC Group NV, 0.125%, 14/01/29	87 505	0,03	
				100 000 EUR	KBC Group NV, 4.250%, 28/11/29	102 746	0,04	
				300 000 EUR	KBC Group NV, 0.750%, 24/01/30	257 628	0,09	
				100 000 EUR	KBC Group NV, 0.750%, 31/05/31	83 848	0,03	
				400 000 EUR	VGP NV, 1.500%, 08/04/29	310 668	0,11	
				200 000 EUR	VGP NV, 2.250%, 17/01/30	157 336	0,06	
				Belgique – Total			4 811 401	1,74

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Canada				Danemark (suite)			
320 000 EUR	Alimentation Couche-Tard Inc, 1.875%, 06/05/26	308 822	0,11	780 000 EUR	Danske Bank A/S, 4.125%, 10/01/31	808 111	0,29
260 000 EUR	Bank of Montreal, 2.750%, 15/06/27	255 744	0,09	100 000 EUR	Danske Bank A/S, 1.000%, 15/05/31	93 308	0,03
100 000 EUR	Bank of Nova Scotia, 0.125%, 04/09/26	92 325	0,03	260 000 EUR	ISS Global A/S, 0.875%, 18/06/26	243 766	0,09
360 000 EUR	Great-West Lifeco Inc, 1.750%, 07/12/26	349 503	0,13	100 000 EUR	ISS Global A/S, 1.500%, 31/08/27	93 358	0,03
100 000 EUR	Magna International Inc, 1.500%, 25/09/27	95 383	0,03	200 000 EUR	Jyske Bank A/S, 5.500%, 16/11/27	209 794	0,08
170 000 EUR	National Bank of Canada, 3.750%, 25/01/28	172 055	0,06	420 000 EUR	Jyske Bank A/S, 0.250%, 17/02/28	381 217	0,14
200 000 EUR	Royal Bank of Canada, 4.125%, 05/07/28	206 366	0,08	250 000 EUR	Pandora A/S, 4.500%, 10/04/28	259 463	0,09
310 000 EUR	Royal Bank of Canada, 4.375%, 02/10/30	325 869	0,12	200 000 EUR	Rwe AG, 2.125%, 24/05/26	195 554	0,07
450 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 2.551%, 03/08/27	440 276	0,16	300 000 EUR	Sydbank AS, 0.500%, 10/11/26	281 376	0,10
120 000 EUR	Toronto-Dominion Bank, 3.129%, 03/08/32	117 367	0,04	100 000 EUR	Vestas Wind Systems A/S, 4.125%, 15/06/26	101 667	0,04
Canada – Total		2 363 710	0,85	200 000 EUR	Vestas Wind Systems A/S, 4.125%, 15/06/31	206 400	0,08
Îles Caïmans				Danemark – Total			
200 000 EUR	CK Hutchison Europe Finance 21 Ltd, 1.000%, 02/11/33	153 398	0,06			4 223 804	1,53
Îles Caïmans – Total		153 398	0,06	Finlande			
Croatie				100 000 EUR	Balder Finland Oyj, 1.000%, 20/01/29	76 338	0,03
200 000 EUR	Erste&Steiermaerkische Banka dd, 0.750%, 06/07/28	171 914	0,06	190 000 EUR	Balder Finland Oyj, 1.375%, 24/05/30	137 862	0,05
Croatie – Total		171 914	0,06	100 000 EUR	Balder Finland Oyj, 2.000%, 18/01/31	73 274	0,03
République tchèque				220 000 EUR	Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 0.875%, 17/09/29	169 693	0,06
200 000 EUR	Ceska sporitelna AS, 5.737%, 08/03/28	206 462	0,08	100 000 EUR	Kojamo oyj, 2.000%, 31/03/26	93 369	0,03
200 000 EUR	Ceska sporitelna AS, 0.500%, 13/09/28	172 942	0,06	300 000 EUR	Neste Oyj, 3.875%, 16/03/29	309 213	0,11
100 000 EUR	Raiffeisenbank AS, 7.125%, 19/01/26	101 077	0,04	150 000 EUR	Neste Oyj, 4.250%, 16/03/33	160 360	0,06
200 000 EUR	Raiffeisenbank AS, 1.000%, 09/06/28	172 088	0,06	100 000 EUR	Nokia Oyj, 2.000%, 11/03/26	96 333	0,03
République tchèque – Total		652 569	0,24	100 000 EUR	Nokia Oyj, 4.375%, 21/08/31	100 533	0,04
Danemark				200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.375%, 28/05/26	187 896	0,07
200 000 EUR	Aareal Bank AG, 0.750%, 18/04/28	172 550	0,06	420 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 14/05/27	387 744	0,14
100 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 3.250%, 12/10/25	100 065	0,04	580 000 EUR	Nordea Bank Abp, 4.125%, 05/05/28	598 763	0,22
100 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 0.875%, 01/07/29	88 881	0,03	200 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 02/11/28	175 676	0,06
100 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 4.250%, 05/10/33	106 290	0,04	530 000 EUR	Nordea Bank Abp, 0.500%, 19/03/31	442 269	0,16
200 000 EUR	Carlsberg Breweries AS, 3.500%, perpetual	202 482	0,07	230 000 EUR	Sampo Oyj, 3.375%, 23/05/49	216 481	0,08
350 000 EUR	Danske Bank A/S, 1.375%, 17/02/27	333 529	0,12	100 000 EUR	Sampo Oyj, 2.500%, 03/09/52	84 035	0,03
240 000 EUR	Danske Bank A/S, 0.750%, 09/06/29	212 462	0,08	100 000 EUR	Sato Oyj, 1.375%, 24/02/28	83 424	0,03
140 000 EUR	Danske Bank A/S, 1.500%, 02/09/30	133 531	0,05	Finlande – Total		3 393 263	1,23
				France			
				100 000 EUR	ALD SA, 1.250%, 02/03/26	95 423	0,03
				100 000 EUR	ALD SA, 4.375%, 23/11/26	102 440	0,04
				400 000 EUR	ALD SA, 4.000%, 05/07/27	408 756	0,15
				100 000 EUR	Alstom SA, 0.250%, 14/10/26	90 586	0,03
				200 000 EUR	Alstom SA, 0.010%, 11/01/29	164 740	0,06
				100 000 EUR	Alstom SA, 0.500%, 27/07/30	81 029	0,03
				200 000 EUR	Altarea SCA, 1.750%, 16/01/30	153 894	0,06
				100 000 EUR	Arkema SA, 0.125%, 14/10/26	92 479	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
100 000 EUR	Arval Service Lease SA, 4.625%, 02/12/24	100 480	0,04	400 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.750%, 25/07/28	389 504	0,14
100 000 EUR	Arval Service Lease SA, 0.875%, 17/02/25	96 677	0,03	200 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.375%, 13/01/29	207 064	0,07
300 000 EUR	Arval Service Lease SA, 0.010%, 01/10/25	282 126	0,10	200 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.125%, 17/04/29	180 532	0,07
200 000 EUR	Arval Service Lease SA, 4.750%, 22/05/27	207 514	0,07	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.375%, 28/05/29	89 932	0,03
500 000 EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.250%, 18/01/27	477 075	0,17	500 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 19/01/30	428 810	0,15
100 000 EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.375%, 22/01/30	91 896	0,03	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.875%, 11/07/30	86 190	0,03
100 000 EUR	Autoroutes du Sud de la France SA, 1.375%, 21/02/31	89 857	0,03	400 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.625%, 02/07/31	341 600	0,12
170 000 EUR	AXA SA, 1.125%, 15/05/28	159 576	0,06	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.100%, 07/04/32	89 318	0,03
200 000 EUR	AXA SA, 3.750%, 12/10/30	210 920	0,08	100 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.125%, 26/09/32	104 742	0,04
620 000 EUR	AXA SA, 1.375%, 07/10/41	512 095	0,19	300 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.750%, 13/11/32	318 273	0,12
100 000 EUR	AXA SA, 1.875%, 10/07/42	82 247	0,03	400 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.625%, 03/12/32	311 608	0,11
100 000 EUR	AXA SA, 4.250%, 10/03/43	98 740	0,04	200 000 EUR	BNP Paribas SA, 4.125%, perpetual	210 860	0,08
100 000 EUR	AXA SA, 3.375%, 06/07/47	97 900	0,04	200 000 EUR	Bouygues SA, 1.125%, 24/07/28	186 368	0,07
110 000 EUR	AXA SA, 3.250%, 28/05/49	105 483	0,04	100 000 EUR	Bouygues SA, 0.500%, 11/02/30	86 794	0,03
200 000 EUR	AXA SA, 3.875%, perpetual	197 342	0,07	100 000 EUR	Bouygues SA, 4.625%, 07/06/32	109 857	0,04
500 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.100%, 08/10/27	447 855	0,16	200 000 EUR	Bouygues SA, 3.250%, 30/06/37	195 676	0,07
200 000 EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.250%, 29/06/28	176 158	0,06	400 000 EUR	Bouygues SA, 5.375%, 30/06/42	475 236	0,17
100 000 EUR	Banque Stellantis France SACA, 3.875%, 19/01/26	100 742	0,04	100 000 EUR	BPCE SA, 0.125%, 04/12/24	96 980	0,04
100 000 EUR	BNP Paribas Cardif SA, 4.032%, perpetual	98 540	0,04	500 000 EUR	BPCE SA, 0.500%, 14/01/28	456 390	0,16
140 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.375%, 17/02/25	138 020	0,05	100 000 EUR	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama, 0.750%, 07/07/28	88 702	0,03
200 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.250%, 19/03/25	194 492	0,07	100 000 EUR	Capgemini SE, 1.625%, 15/04/26	96 838	0,04
380 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.625%, 23/02/26	368 482	0,13	400 000 EUR	Capgemini SE, 2.000%, 15/04/29	382 772	0,14
400 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 04/06/26	382 560	0,14	200 000 EUR	Capgemini SE, 1.125%, 23/06/30	178 590	0,06
200 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.875%, 01/10/26	197 806	0,07	100 000 EUR	Capgemini SE, 2.375%, 15/04/32	94 726	0,03
380 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.250%, 11/01/27	369 227	0,13	200 000 EUR	Carmila SA, 5.500%, 09/10/28	207 504	0,07
500 000 EUR	BNP Paribas SA, 2.125%, 23/01/27	485 770	0,18	100 000 EUR	Carrefour Banque SA, 0.107%, 14/06/25	95 284	0,03
100 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.250%, 13/04/27	92 801	0,03	100 000 EUR	Carrefour SA, 1.250%, 03/06/25	97 010	0,04
200 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.375%, 14/10/27	184 502	0,07	100 000 EUR	Carrefour SA, 1.750%, 04/05/26	96 990	0,04
200 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 19/02/28	181 994	0,07	100 000 EUR	Carrefour SA, 1.000%, 17/05/27	93 414	0,03
380 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.500%, 23/05/28	356 182	0,13	200 000 EUR	Carrefour SA, 2.625%, 15/12/27	196 162	0,07
100 000 EUR	BNP Paribas SA, 1.500%, 25/05/28	94 655	0,03	100 000 EUR	Carrefour SA, 4.375%, 14/11/31	106 031	0,04
300 000 EUR	BNP Paribas SA, 0.500%, 30/05/28	271 638	0,10	100 000 EUR	Carrefour SA, 3.750%, perpetual	102 077	0,04
				100 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.875%, 03/09/25	96 325	0,03
				100 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.010%, 02/11/28	88 203	0,03
				200 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.250%, 02/11/32	160 664	0,06
				200 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 2.500%, 03/09/38	186 728	0,07

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
100 000 EUR	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, 0.625%, 02/11/40	67 804	0,02	200 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.875%, 28/11/34	209 412	0,08
200 000 EUR	Cofiroute SA, 0.375%, 07/02/25	193 290	0,07	300 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.875%, perpetual	310 050	0,11
200 000 EUR	Cofiroute SA, 1.125%, 13/10/27	188 200	0,07	100 000 EUR	Dassault Systemes SE, 0.125%, 16/09/26	93 197	0,03
100 000 EUR	Cofiroute SA, 0.750%, 09/09/28	91 655	0,03	100 000 EUR	Dassault Systemes SE, 0.375%, 16/09/29	88 099	0,03
100 000 EUR	Cofiroute SA, 1.000%, 19/05/31	86 600	0,03	100 000 EUR	Edenred SE, 1.875%, 30/03/27	96 466	0,03
100 000 EUR	Covivio SA, 1.875%, 20/05/26	96 272	0,03	200 000 EUR	Edenred SE, 1.375%, 18/06/29	183 936	0,07
300 000 EUR	Covivio SA, 1.125%, 17/09/31	246 849	0,09	100 000 EUR	Edenred SE, 3.625%, 13/06/31	101 734	0,04
100 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 2.000%, 17/07/30	87 745	0,03	500 000 EUR	Engie SA, 2.375%, 19/05/26	489 865	0,18
100 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 1.500%, 06/10/31	81 572	0,03	100 000 EUR	Engie SA, 0.375%, 21/06/27	91 295	0,03
100 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 2.625%, 29/01/48	92 957	0,03	100 000 EUR	Engie SA, 1.500%, 27/03/28	94 101	0,03
300 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 4.750%, 27/09/48	302 304	0,11	400 000 EUR	Engie SA, 1.750%, 27/03/28	379 468	0,14
300 000 EUR	Credit Agricole Assurances SA, 4.250%, perpetual	298 299	0,11	300 000 EUR	Engie SA, 1.375%, 28/02/29	276 207	0,10
300 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.375%, 21/10/25	285 903	0,10	400 000 EUR	Engie SA, 0.500%, 24/10/30	334 188	0,12
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.250%, 14/04/26	95 827	0,03	100 000 EUR	Engie SA, 2.125%, 30/03/32	91 745	0,03
400 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.000%, 22/04/26	385 960	0,14	300 000 EUR	Engie SA, 1.375%, 21/06/39	217 695	0,08
500 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.875%, 20/12/26	481 355	0,17	300 000 EUR	Engie SA, 4.500%, 06/09/42	323 115	0,12
310 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.625%, 17/03/27	300 703	0,11	200 000 EUR	Engie SA, 3.250%, perpetual	197 248	0,07
400 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.375%, 03/05/27	379 048	0,14	200 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.125%, 27/05/25	191 170	0,07
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 3.375%, 28/07/27	100 700	0,04	200 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.375%, 05/01/26	189 904	0,07
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.625%, 12/01/28	183 918	0,07	100 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.375%, 27/11/27	91 466	0,03
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.375%, 20/04/28	176 694	0,06	200 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.500%, 05/06/28	182 444	0,07
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.750%, 05/03/29	184 714	0,07	200 000 EUR	EssilorLuxottica SA, 0.750%, 27/11/31	172 490	0,06
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.000%, 25/03/29	185 438	0,07	400 000 EUR	Gecina SA, 1.375%, 30/06/27	380 880	0,14
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.000%, 03/07/29	89 121	0,03	400 000 EUR	Gecina SA, 1.375%, 26/01/28	374 968	0,14
300 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.500%, 21/09/29	261 741	0,09	200 000 EUR	Gecina SA, 1.625%, 14/03/30	185 266	0,07
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.625%, 05/06/30	193 248	0,07	300 000 EUR	Gecina SA, 2.000%, 30/06/32	276 720	0,10
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 0.875%, 14/01/32	82 248	0,03	100 000 EUR	Gecina SA, 1.625%, 29/05/34	86 894	0,03
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 1.125%, 12/07/32	83 817	0,03	200 000 EUR	Gecina SA, 0.875%, 30/06/36	147 834	0,05
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.000%, 18/01/33	105 172	0,04	400 000 EUR	HSBC Continental Europe SA, 0.100%, 03/09/27	358 912	0,13
200 000 EUR	Credit Agricole SA, 4.375%, 27/11/33	210 028	0,08	200 000 EUR	ICADE, 1.750%, 10/06/26	190 920	0,07
100 000 EUR	Credit Agricole SA, 2.500%, 22/04/34	91 924	0,03	100 000 EUR	ICADE, 1.500%, 13/09/27	93 032	0,03
				200 000 EUR	ICADE, 1.625%, 28/02/28	185 974	0,07
				200 000 EUR	ICADE, 0.625%, 18/01/31	157 640	0,06
				100 000 EUR	JCDecaux SE, 2.625%, 24/04/28	97 953	0,04
				200 000 EUR	Kering SA, 1.250%, 05/05/25	194 358	0,07
				200 000 EUR	Kering SA, 3.750%, 05/09/25	201 524	0,07
				300 000 EUR	Kering SA, 0.750%, 13/05/28	274 935	0,10
				200 000 EUR	Kering SA, 1.875%, 05/05/30	188 632	0,07
				100 000 EUR	Kering SA, 3.625%, 05/09/31	103 414	0,04
				100 000 EUR	Kering SA, 3.875%, 05/09/35	104 837	0,04
				300 000 EUR	Klepierre SA, 2.000%, 12/05/29	281 451	0,10
				300 000 EUR	Klepierre SA, 0.875%, 17/02/31	249 552	0,09
				100 000 EUR	Legrand SA, 1.875%, 16/12/27	95 968	0,03
				100 000 EUR	Legrand SA, 3.500%, 29/05/29	103 324	0,04

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
100 000 EUR	Legrand SA, 0.750%, 20/05/30	87 639	0,03	120 000 EUR	RCI Banque SA, 4.875%, 21/09/28	126 964	0,05
300 000 EUR	L'Oreal SA, 0.875%, 29/06/26	286 038	0,10	200 000 EUR	Sanofi SA, 1.000%, 01/04/25	194 276	0,07
200 000 EUR	L'Oreal SA, 3.375%, 23/01/27	203 272	0,07	100 000 EUR	Sanofi SA, 1.500%, 22/09/25	97 444	0,04
100 000 EUR	L'Oreal SA, 3.375%, 23/11/29	103 096	0,04	100 000 EUR	Sanofi SA, 1.000%, 21/03/26	96 075	0,03
200 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.750%, 07/04/25	193 954	0,07	400 000 EUR	Sanofi SA, 1.750%, 10/09/26	389 352	0,14
100 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.010%, 11/02/26	94 269	0,03	300 000 EUR	Sanofi SA, 0.500%, 13/01/27	281 517	0,10
300 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.125%, 11/02/28	271 230	0,10	200 000 EUR	Sanofi SA, 1.375%, 21/03/30	184 700	0,07
100 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.250%, 07/09/29	101 841	0,04	200 000 EUR	Sanofi SA, 1.500%, 01/04/30	185 898	0,07
200 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 0.375%, 11/02/31	170 696	0,06	100 000 EUR	Sanofi SA, 1.250%, 21/03/34	86 975	0,03
200 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.500%, 07/09/33	206 562	0,07	100 000 EUR	Sanofi SA, 1.875%, 21/03/38	88 176	0,03
200 000 EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3.375%, perpetual	201 310	0,07	100 000 EUR	Schneider Electric SE, 0.875%, 11/03/25	97 405	0,04
200 000 EUR	Mercialys SA, 2.500%, 28/02/29	182 562	0,07	200 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.250%, 12/06/28	204 190	0,07
100 000 EUR	Nerval SAS, 2.875%, 14/04/32	90 029	0,03	400 000 EUR	Schneider Electric SE, 0.250%, 11/03/29	352 756	0,13
200 000 EUR	New Immo Holding SA, 2.750%, 26/11/26	183 960	0,07	100 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.500%, 09/11/32	104 322	0,04
100 000 EUR	Orange SA, 1.000%, 12/05/25	96 823	0,03	100 000 EUR	Schneider Electric SE, 3.500%, 12/06/33	103 893	0,04
200 000 EUR	Orange SA, 0.010%, 04/09/26	185 402	0,07	200 000 EUR	SCOR SE, 3.625%, 27/05/48	196 902	0,07
400 000 EUR	Orange SA, 0.125%, 16/09/29	345 384	0,12	200 000 EUR	Societe Fonciere Lyonnaise SA, 0.500%, 21/04/28	179 428	0,06
300 000 EUR	Orange SA, 1.375%, 16/01/30	275 730	0,10	100 000 EUR	Societe Generale SA, 1.125%, 23/01/25	97 186	0,04
200 000 EUR	Orange SA, 0.500%, 04/09/32	163 180	0,06	300 000 EUR	Societe Generale SA, 2.625%, 27/02/25	295 593	0,11
475 000 EUR	Orange SA, 8.125%, 28/01/33	665 998	0,24	200 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 24/02/26	187 320	0,07
100 000 EUR	Orange SA, 1.200%, 11/07/34	83 156	0,03	200 000 EUR	Societe Generale SA, 1.125%, 21/04/26	193 042	0,07
400 000 EUR	Orange SA, 1.375%, 04/09/49	303 046	0,11	100 000 EUR	Societe Generale SA, 4.250%, 28/09/26	102 507	0,04
220 000 EUR	Orange SA, 5.000%, perpetual	224 558	0,08	100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 17/11/26	93 873	0,03
300 000 EUR	Orange SA, 2.375%, perpetual	291 708	0,11	300 000 EUR	Societe Generale SA, 0.750%, 25/01/27	275 922	0,10
100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.125%, 07/04/25	97 177	0,04	200 000 EUR	Societe Generale SA, 4.125%, 02/06/27	205 168	0,07
100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.500%, 18/05/26	97 068	0,04	100 000 EUR	Societe Generale SA, 0.250%, 08/07/27	90 028	0,03
100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 3.250%, 02/11/28	101 515	0,04	200 000 EUR	Societe Generale SA, 4.000%, 16/11/27	204 764	0,07
100 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.375%, 07/04/29	92 603	0,03	300 000 EUR	Societe Generale SA, 0.625%, 02/12/27	275 025	0,10
400 000 EUR	Pernod Ricard SA, 1.750%, 08/04/30	371 168	0,13	200 000 EUR	Societe Generale SA, 1.375%, 13/01/28	185 496	0,07
100 000 EUR	PSA Tresorerie GIE, 6.000%, 19/09/33	118 174	0,04	200 000 EUR	Societe Generale SA, 0.125%, 18/02/28	176 648	0,06
200 000 EUR	RCI Banque SA, 1.750%, 10/04/26	192 092	0,07	200 000 EUR	Societe Generale SA, 0.875%, 22/09/28	181 516	0,07
340 000 EUR	RCI Banque SA, 1.625%, 26/05/26	325 213	0,12	100 000 EUR	Societe Generale SA, 2.125%, 27/09/28	94 474	0,03
60 000 EUR	RCI Banque SA, 1.125%, 15/01/27	56 150	0,02	100 000 EUR	Societe Generale SA, 1.750%, 22/03/29	90 877	0,03
100 000 EUR	RCI Banque SA, 4.500%, 06/04/27	102 729	0,04				
200 000 EUR	RCI Banque SA, 4.750%, 06/07/27	208 736	0,08				
250 000 EUR	RCI Banque SA, 4.875%, 14/06/28	263 088	0,10				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
100 000 EUR	Societe Generale SA, 2.625%, 30/05/29	97 245	0,04	100 000 EUR	Worldline SA, 0.875%, 30/06/27	90 294	0,03
200 000 EUR	Societe Generale SA, 0.500%, 12/06/29	173 442	0,06	190 000 EUR	WPP Finance SA, 2.375%, 19/05/27	186 305	0,07
200 000 EUR	Societe Generale SA, 4.750%, 28/09/29	208 416	0,08	France – Total			
100 000 EUR	Societe Generale SA, 1.250%, 12/06/30	86 004	0,03	48 798 696			
300 000 EUR	Societe Generale SA, 4.250%, 06/12/30	304 935	0,11	17,63			
200 000 EUR	Societe Generale SA, 1.125%, 30/06/31	183 882	0,07	Allemagne			
300 000 EUR	Societe Generale SA, 4.875%, 21/11/31	313 746	0,11	100 000 EUR	Aareal Bank AG, 4.500%, 25/07/25	100 227	0,04
100 000 EUR	Societe Generale SA, 5.625%, 02/06/33	106 619	0,04	200 000 EUR	Aareal Bank AG, 0.050%, 02/09/26	178 662	0,06
250 000 EUR	Sodexo SA, 0.750%, 27/04/25	241 568	0,09	200 000 EUR	Aareal Bank AG, 0.500%, 07/04/27	176 984	0,06
100 000 EUR	Sodexo SA, 0.750%, 14/04/27	94 841	0,03	100 000 EUR	adidas AG, 0.010%, 05/10/28	88 267	0,03
100 000 EUR	Sodexo SA, 1.000%, 17/07/28	91 922	0,03	200 000 EUR	Allianz SE, 2.241%, 07/07/45	194 078	0,07
570 000 EUR	Sodexo SA, 1.000%, 27/04/29	517 788	0,19	400 000 EUR	Allianz SE, 3.099%, 06/07/47	391 732	0,14
200 000 EUR	Sogecap SA, 4.125%, perpetual	197 108	0,07	300 000 EUR	Allianz SE, 2.121%, 08/07/50	264 354	0,10
300 000 EUR	Stellantis NV, 2.750%, 15/05/26	296 703	0,11	200 000 EUR	Allianz SE, 4.252%, 05/07/52	198 138	0,07
400 000 EUR	Teleperformance SE, 3.750%, 24/06/29	398 628	0,14	100 000 EUR	Allianz SE, 5.824%, 25/07/53	109 469	0,04
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.125%, 09/04/25	196 120	0,07	100 000 EUR	alstria office REIT-AG, 0.500%, 26/09/25	86 322	0,03
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.125%, 15/09/25	96 361	0,03	100 000 EUR	alstria office REIT-AG, 1.500%, 15/11/27	74 722	0,03
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.500%, 04/06/26	196 990	0,07	100 000 EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 0.750%, 04/05/26	94 831	0,03
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0.625%, 04/05/27	182 894	0,07	100 000 EUR	Amphenol Technologies Holding GmbH, 2.000%, 08/10/28	96 419	0,04
310 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.500%, 22/02/28	290 169	0,10	200 000 EUR	Amprion GmbH, 3.450%, 22/09/27	202 254	0,07
320 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.375%, 15/04/30	281 878	0,10	100 000 EUR	Amprion GmbH, 3.875%, 07/09/28	103 136	0,04
100 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 4.125%, 11/12/30	103 187	0,04	500 000 EUR	Amprion GmbH, 3.971%, 22/09/32	520 880	0,19
300 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.000%, 29/06/32	265 743	0,10	200 000 EUR	Amprion GmbH, 4.125%, 07/09/34	210 442	0,08
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 2.000%, 29/05/37	163 792	0,06	200 000 EUR	Berlin Hyp AG, 1.125%, 25/10/27	183 086	0,07
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1.750%, 01/07/49	130 260	0,05	300 000 EUR	Berlin Hyp AG, 1.500%, 18/04/28	274 641	0,10
200 000 EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 7.250%, perpetual	199 716	0,07	100 000 EUR	Berlin Hyp AG, 0.500%, 05/11/29	85 036	0,03
100 000 EUR	Vinci SA, 1.000%, 26/09/25	96 748	0,03	300 000 EUR	Clearstream Banking AG, 0.010%, 01/12/25	283 968	0,10
200 000 EUR	Vinci SA, 0.010%, 27/11/28	175 568	0,06	300 000 EUR	Commerzbank AG, 1.125%, 22/06/26	284 319	0,10
200 000 EUR	Vinci SA, 1.625%, 18/01/29	188 638	0,07	340 000 EUR	Commerzbank AG, 0.375%, 01/09/27	310 903	0,11
200 000 EUR	Vinci SA, 1.750%, 26/09/30	185 876	0,07	300 000 EUR	Commerzbank AG, 3.000%, 14/09/27	293 676	0,11
100 000 EUR	Vivendi SE, 0.625%, 11/06/25	96 183	0,03	200 000 EUR	Commerzbank AG, 1.875%, 28/02/28	189 884	0,07
100 000 EUR	Vivendi SE, 1.875%, 26/05/26	97 805	0,04	200 000 EUR	Commerzbank AG, 5.125%, 18/01/30	209 298	0,08
100 000 EUR	Vivendi SE, 1.125%, 11/12/28	94 802	0,03	200 000 EUR	Continental AG, 2.500%, 27/08/26	197 606	0,07
100 000 EUR	Wendel SE, 1.000%, 01/06/31	83 810	0,03	100 000 EUR	Continental AG, 4.000%, 01/06/28	103 193	0,04
				200 000 EUR	Covestro AG, 4.750%, 15/11/28	213 048	0,08
				200 000 EUR	Deutsche Bank AG, 2.750%, 17/02/25	197 408	0,07
				200 000 EUR	Deutsche Bank AG, 2.625%, 12/02/26	196 220	0,07
				320 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.375%, 10/06/26	310 163	0,11
				200 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.625%, 20/01/27	187 934	0,07

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
200 000 EUR	Deutsche Bank AG, 0.750%, 17/02/27	186 762	0,07	50 000 EUR	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, 1.500%, 29/05/30	43 148	0,02
400 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.875%, 23/02/28	375 956	0,14	300 000 EUR	Hannover Rueck SE, 1.125%, 09/10/39	255 027	0,09
200 000 EUR	Deutsche Bank AG, 3.250%, 24/05/28	195 734	0,07	100 000 EUR	Hannover Rueck SE, 1.375%, 30/06/42	80 775	0,03
200 000 EUR	Deutsche Bank AG, 5.000%, 05/09/30	206 576	0,07	100 000 EUR	Hannover Rueck SE, 5.875%, 26/08/43	111 573	0,04
400 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.750%, 19/11/30	347 612	0,13	200 000 EUR	Hannover Rueck SE, 3.375%, perpetual	196 454	0,07
400 000 EUR	Deutsche Bank AG, 1.375%, 17/02/32	328 564	0,12	280 000 EUR	Hella GmbH & Co KGaA, 0.500%, 26/01/27	255 136	0,09
100 000 EUR	Deutsche Bank AG, 4.000%, 24/06/32	96 170	0,03	200 000 EUR	Henkel AG & Co KGaA, 2.625%, 13/09/27	198 862	0,07
100 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.125%, 26/03/28	94 177	0,03	340 000 EUR	Hochtief AG, 0.625%, 26/04/29	294 222	0,11
200 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.500%, 04/04/32	181 410	0,07	200 000 EUR	Infineon Technologies AG, 1.625%, 24/06/29	185 338	0,07
300 000 EUR	Deutsche Boerse AG, 1.250%, 16/06/47	271 035	0,10	100 000 EUR	Infineon Technologies AG, 2.000%, 24/06/32	90 809	0,03
200 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.625%, 05/12/28	190 438	0,07	80 000 EUR	Knorr-Bremse AG, 1.125%, 13/06/25	77 613	0,03
100 000 EUR	Deutsche Post AG, 1.000%, 20/05/32	88 957	0,03	150 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.375%, 11/05/28	141 552	0,05
200 000 EUR	Deutsche Post AG, 3.375%, 03/07/33	204 204	0,07	200 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.500%, 03/07/29	187 094	0,07
55 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 0.875%, 25/03/26	52 631	0,02	100 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.750%, 08/02/30	87 667	0,03
100 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 0.500%, 05/07/27	93 332	0,03	50 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.375%, 22/05/30	48 234	0,02
360 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 1.750%, 25/03/31	338 216	0,12	340 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.750%, 10/09/30	294 957	0,11
100 000 EUR	Deutsche Telekom AG, 2.250%, 29/03/39	93 780	0,03	200 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 1.125%, 06/11/31	175 010	0,06
200 000 EUR	Deutsche Wohnen SE, 1.500%, 30/04/30	174 820	0,06	355 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.750%, 11/03/33	292 932	0,11
100 000 EUR	EON SE, 0.875%, 08/01/25	97 484	0,04	100 000 EUR	Mercedes-Benz Group AG, 2.125%, 03/07/37	90 378	0,03
390 000 EUR	EON SE, 1.000%, 07/10/25	376 346	0,14	125 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.850%, 28/02/25	121 428	0,04
390 000 EUR	EON SE, 0.375%, 29/09/27	356 191	0,13	300 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.625%, 07/04/25	297 147	0,11
230 000 EUR	EON SE, 3.500%, 12/01/28	235 354	0,09	100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.500%, 09/03/26	96 687	0,04
100 000 EUR	EON SE, 0.750%, 20/02/28	92 638	0,03	100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 2.000%, 22/08/26	97 920	0,04
100 000 EUR	EON SE, 0.100%, 19/12/28	89 296	0,03	200 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.375%, 08/11/26	186 726	0,07
200 000 EUR	EON SE, 1.625%, 22/05/29	188 358	0,07	100 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.125%, 16/07/25	95 174	0,03
200 000 EUR	EON SE, 0.350%, 28/02/30	169 760	0,06	200 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.375%, 05/07/27	183 702	0,07
300 000 EUR	EON SE, 1.625%, 29/03/31	270 882	0,10	100 000 EUR	Merck Financial Services GmbH, 0.500%, 16/07/28	89 917	0,03
370 000 EUR	EON SE, 0.875%, 20/08/31	315 296	0,11	200 000 EUR	Merck KGaA, 3.375%, 12/12/74	197 982	0,07
100 000 EUR	EON SE, 0.600%, 01/10/32	81 286	0,03	100 000 EUR	Merck KGaA, 1.625%, 09/09/80	92 777	0,03
100 000 EUR	EON SE, 3.500%, 26/10/37	97 610	0,04	140 000 EUR	MTU Aero Engines AG, 3.000%, 01/07/25	138 779	0,05
350 000 EUR	EON SE, 0.875%, perpetual	281 670	0,10				
350 000 EUR	EON SE, 3.875%, perpetual	363 818	0,13				
100 000 EUR	Eurogrid GmbH, 3.279%, 05/09/31	99 420	0,04				
300 000 EUR	Eurogrid GmbH, 1.113%, 15/05/32	251 766	0,09				
100 000 EUR	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, 0.625%, 30/11/26	91 503	0,03				
200 000 EUR	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA, 1.250%, 29/11/29	174 080	0,06				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)			
400 000 EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.375%, 09/03/29	339 404	0,12	150 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 4.750%, 25/09/31	159 996	0,06
200 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 1.250%, 26/05/41	165 770	0,06	100 000 EUR	Vonovia SE, 0.010%, 01/12/25	93 239	0,03
500 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 1.000%, 26/05/42	394 200	0,14	100 000 EUR	Vonovia SE, 0.375%, 16/06/27	89 400	0,03
200 000 EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3.250%, 26/05/49	193 674	0,07	200 000 EUR	Vonovia SE, 1.875%, 28/06/28	184 776	0,07
100 000 EUR	Rwe AG, 0.625%, 11/06/31	83 769	0,03	200 000 EUR	Vonovia SE, 0.250%, 01/09/28	169 816	0,06
300 000 EUR	RWE AG, 0.500%, 26/11/28	267 468	0,10	100 000 EUR	Vonovia SE, 5.000%, 23/11/30	105 705	0,04
480 000 EUR	RWE AG, 2.750%, 24/05/30	464 251	0,17	300 000 EUR	Vonovia SE, 0.625%, 24/03/31	236 406	0,09
100 000 EUR	RWE AG, 1.000%, 26/11/33	79 870	0,03	400 000 EUR	Vonovia SE, 0.750%, 01/09/32	303 940	0,11
300 000 EUR	RWE AG, 4.125%, 13/02/35	311 598	0,11	100 000 EUR	Vonovia SE, 1.000%, 16/06/33	75 939	0,03
100 000 EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.500%, 30/06/26	102 241	0,04	200 000 EUR	Vonovia SE, 1.500%, 14/06/41	130 060	0,05
100 000 EUR	Santander Consumer Bank AG, 4.375%, 13/09/27	103 062	0,04	100 000 EUR	Vonovia SE, 1.625%, 01/09/51	57 871	0,02
100 000 EUR	SAP SE, 1.000%, 13/03/26	96 357	0,03	100 000 EUR	WPP Finance Deutschland GmbH, 1.625%, 23/03/30	91 112	0,03
100 000 EUR	SAP SE, 0.125%, 18/05/26	94 085	0,03	Allemagne – Total		26 697 762	9,65
100 000 EUR	SAP SE, 1.750%, 22/02/27	99 148	0,04	Guernesey			
300 000 EUR	SAP SE, 1.250%, 10/03/28	284 247	0,10	300 000 EUR	Sirius Real Estate Ltd, 1.750%, 24/11/28	247 971	0,09
100 000 EUR	SAP SE, 0.375%, 18/05/29	88 959	0,03	Guernesey – Total		247 971	0,09
100 000 EUR	SAP SE, 1.625%, 10/03/31	93 287	0,03	Islande			
200 000 EUR	Talanx AG, 1.750%, 01/12/42	165 390	0,06	200 000 EUR	Arion Banki HF, 0.375%, 14/07/25	187 508	0,07
100 000 EUR	Talanx AG, 2.250%, 05/12/47	93 260	0,03	Islande – Total		187 508	0,07
500 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 4.625%, 03/05/31	524 310	0,19	Irlande			
300 000 EUR	Volkswagen Bank GmbH, 4.375%, perpetual	309 327	0,11	200 000 EUR	Abbott Ireland Financing DAC, 1.500%, 27/09/26	193 010	0,07
40 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.010%, 12/02/25	38 413	0,01	100 000 EUR	AIB Group PLC, 2.250%, 03/07/25	98 264	0,04
300 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 3.000%, 06/04/25	298 164	0,11	240 000 EUR	AIB Group PLC, 3.625%, 04/07/26	240 010	0,09
65 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.125%, 12/02/27	59 019	0,02	280 000 EUR	AIB Group PLC, 0.500%, 17/11/27	256 922	0,09
200 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 2.250%, 01/10/27	194 738	0,07	200 000 EUR	AIB Group PLC, 5.750%, 16/02/29	214 968	0,08
200 000 EUR	Volkswagen Financial Services AG, 0.375%, 12/02/30	165 236	0,06	400 000 EUR	AIB Group PLC, 5.250%, 23/10/31	432 080	0,16
365 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.375%, perpetual	338 439	0,12	100 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 1.875%, 05/06/26	97 255	0,03
325 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.375%, 20/01/25	317 083	0,11	280 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 0.375%, 10/05/27	260 291	0,09
300 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.625%, 15/08/25	291 357	0,11	200 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 4.875%, 16/07/28	209 102	0,08
200 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 4.500%, 25/03/26	204 376	0,07	250 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 4.625%, 13/11/29	259 752	0,09
250 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 1.500%, 19/06/26	239 193	0,09	200 000 EUR	Bank of Ireland Group PLC, 5.000%, 04/07/31	213 378	0,08
35 000 EUR	Volkswagen Leasing GmbH, 0.500%, 12/01/29	30 355	0,01	100 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.010%, 06/09/25	94 578	0,03
				100 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.500%, 06/09/29	86 605	0,03
				100 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 0.875%, 06/05/33	80 789	0,03
				100 000 EUR	CCEP Finance Ireland DAC, 1.500%, 06/05/41	74 163	0,03
				200 000 EUR	DXC Capital Funding DAC, 0.450%, 15/09/27	177 536	0,06
				100 000 EUR	Eaton Capital UnLtd Co, 0.577%, 08/03/30	86 341	0,03
				100 000 EUR	GE Capital European Funding Unlimited Co, 6.025%, 01/03/38	124 898	0,04

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Irlande (suite)				Italie (suite)			
100 000 EUR	Grenke Finance PLC, 0.625%, 09/01/25	95 718	0,03	100 000 EUR	FinecoBank Banca Fineco SpA, 4.625%, 23/02/29	101 961	0,04
200 000 EUR	Grenke Finance PLC, 7.875%, 06/04/27	215 774	0,08	250 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.625%, 21/04/25	243 932	0,09
100 000 EUR	Johnson Controls International PLC, 1.375%, 25/02/25	97 256	0,04	390 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 2.125%, 26/05/25	382 212	0,14
200 000 EUR	Johnson Controls International PLC, 4.250%, 23/05/35	211 998	0,08	370 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.625%, 24/02/26	347 815	0,13
100 000 EUR	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 0.375%, 15/09/27	90 266	0,03	200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.750%, 06/09/27	207 320	0,07
200 000 EUR	Kerry Group Financial Services Unltd Co, 2.375%, 10/09/25	197 320	0,07	550 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.000%, 08/03/28	568 997	0,21
300 000 EUR	Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2.875%, 15/01/26	295 557	0,11	300 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.750%, 16/03/28	270 234	0,10
100 000 EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 0.500%, 22/09/29	85 528	0,03	200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.750%, 20/03/28	186 754	0,07
200 000 EUR	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1.000%, 22/09/33	159 678	0,06	100 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.750%, 04/07/29	91 101	0,03
100 000 EUR	Vodafone International Financing DAC, 4.000%, 10/02/43 Zurich Finance Ireland	101 304	0,04	250 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.250%, 13/01/30	268 187	0,10
100 000 EUR	Designated Activity Co, 1.875%, 17/09/50	87 037	0,03	300 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 5.625%, 08/03/33	323 061	0,12
Irlande – Total		4 837 378	1,75	200 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.000%, perpetual	202 928	0,07
Italie				400 000 EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 4.875%, perpetual	420 716	0,15
100 000 EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.625%, 02/02/29	91 772	0,03	200 000 EUR	Iren SpA, 1.500%, 24/10/27	188 828	0,07
280 000 EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.750%, 30/07/31	241 480	0,09	150 000 EUR	Italgas SpA, 1.625%, 19/01/27	143 468	0,05
300 000 EUR	Anima Holding SpA, 1.500%, 22/04/28	269 991	0,10	300 000 EUR	Italgas SpA, 4.125%, 08/06/32	310 218	0,11
100 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.124%, 01/10/30	88 096	0,03	100 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.625%, 07/01/25	97 709	0,03
250 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.429%, 14/07/31	218 322	0,08	310 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.125%, 15/07/25	298 387	0,11
100 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 1.713%, 30/06/32	80 532	0,03	100 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 0.875%, 15/01/26	95 140	0,03
200 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.800%, 06/07/32	215 712	0,08	300 000 EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.000%, 08/09/27	276 459	0,10
400 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.500%, 27/10/47	415 568	0,15	200 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 1.000%, 10/04/26	190 790	0,07
150 000 EUR	Assicurazioni Generali SpA, 5.000%, 08/06/48	154 544	0,06	300 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.375%, 23/06/29	259 020	0,09
100 000 EUR	ASTM SpA, 1.000%, 25/11/26	93 215	0,03	100 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0.750%, 24/07/32	81 514	0,03
100 000 EUR	ASTM SpA, 1.500%, 25/01/30	86 947	0,03	100 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3.875%, 24/07/33	103 104	0,04
240 000 EUR	ASTM SpA, 2.375%, 25/11/33	201 370	0,07	420 000 EUR	Unicredit SpA, 1.625%, 18/01/32	359 050	0,13
100 000 EUR	Azimut Holding SpA, 1.625%, 12/12/24	97 783	0,03	400 000 EUR	UniCredit SpA, 0.500%, 09/04/25	384 368	0,14
300 000 EUR	Banco BPM SpA, 0.875%, 15/07/26	281 259	0,10	250 000 EUR	UniCredit SpA, 1.200%, 20/01/26	242 655	0,09
100 000 EUR	Banco BPM SpA, 4.625%, 29/11/27	103 082	0,04	430 000 EUR	UniCredit SpA, 1.250%, 16/06/26	415 049	0,15
100 000 EUR	Covivio SA, 2.375%, 20/02/28	95 693	0,03	270 000 EUR	UniCredit SpA, 4.800%, 17/01/29	282 587	0,10
100 000 EUR	ERG SpA, 1.875%, 11/04/25	98 027	0,04	150 000 EUR	UniCredit SpA, 4.450%, 16/02/29	153 456	0,06
230 000 EUR	ERG SpA, 0.500%, 11/09/27	207 736	0,07	100 000 EUR	UniCredit SpA, 0.800%, 05/07/29	88 912	0,03
100 000 EUR	ERG SpA, 0.875%, 15/09/31	80 298	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Italie (suite)				Japon (suite)			
250 000 EUR	UniCredit SpA, 1.800%, 20/01/30	224 370	0,08	200 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 1.000%, 09/07/29	178 210	0,06
100 000 EUR	UniCredit SpA, 0.850%, 19/01/31	82 446	0,03	250 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 3.000%, 21/11/30	246 577	0,09
Italie – Total			3,98	100 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 1.375%, 09/07/32	85 562	0,03
Japon				Japon – Total			
100 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 1.151%, 19/09/25	96 397	0,04				5 579 413
260 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 0.336%, 19/04/27	236 855	0,08	Jersey			
100 000 EUR	Asahi Group Holdings Ltd, 0.541%, 23/10/28	88 278	0,03	200 000 EUR	Aptiv PLC, 1.500%, 10/03/25	194 758	0,07
360 000 EUR	East Japan Railway Co, 2.614%, 08/09/25	355 863	0,13	Jersey – Total			194 758
100 000 EUR	East Japan Railway Co, 3.976%, 05/09/32	106 444	0,04	Liechtenstein			
100 000 EUR	East Japan Railway Co, 1.104%, 15/09/39	72 099	0,03	320 000 EUR	Swiss Life Finance I Ltd, 0.500%, 15/09/31	259 494	0,09
170 000 EUR	East Japan Railway Co, 4.389%, 05/09/43	184 719	0,07	Liechtenstein – Total			259 494
200 000 EUR	East Japan Railway Co, 4.110%, perpetual	211 260	0,08	Luxembourg			
380 000 EUR	Mitsubishi ufj Financial Group Inc, 3.556%, perpetual	388 626	0,14	200 000 EUR	Acef Holding SCA, 0.750%, 14/06/28	172 036	0,06
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.214%, 07/10/25	94 908	0,03	100 000 EUR	Acef Holding SCA, 1.250%, 26/04/30	80 179	0,03
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.184%, 13/04/26	93 264	0,03	100 000 EUR	Aroundtown SA, 1.000%, 07/01/25	95 249	0,04
380 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 4.157%, 20/05/28	389 937	0,14	300 000 EUR	Aroundtown SA, 0.625%, 09/07/25	277 314	0,10
270 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.797%, 15/04/30	229 022	0,08	200 000 EUR	Aroundtown SA, 1.625%, 31/01/28	162 386	0,06
100 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.693%, 07/10/30	83 276	0,03	100 000 EUR	Aroundtown SA, 1.625%, perpetual	32 272	0,01
390 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.843%, 12/04/33	315 007	0,11	200 000 EUR	AXA Logistics Europe Master SCA, 0.875%, 15/11/29	167 064	0,06
300 000 EUR	Mizuho Financial Group Inc, 0.470%, perpetual	259 095	0,09	100 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.208%, 04/06/26	95 459	0,04
200 000 EUR	Nidec Corp, 0.046%, 30/03/26	184 564	0,07	150 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 0.334%, 13/08/28	132 087	0,05
100 000 EUR	Nissan Motor Co Ltd, 2.652%, 17/03/26	97 609	0,04	100 000 EUR	Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1.213%, 12/02/36	77 367	0,03
100 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.010%, 03/03/25	95 980	0,04	410 000 EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1.625%, 20/04/30	328 131	0,12
140 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.082%, 13/12/25	131 883	0,05	100 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.750%, 12/09/25	97 316	0,04
360 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.399%, 13/12/28	319 774	0,12	100 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.750%, 25/03/27	95 751	0,04
200 000 EUR	NTT Finance Corp, 0.342%, 03/03/30	172 070	0,06	100 000 EUR	CNH Industrial Finance Europe SA, 1.625%, 03/07/29	91 004	0,03
100 000 EUR	ORIX Corp, 4.477%, 01/06/28	105 032	0,04	310 000 EUR	CPI Property Group SA, 2.750%, 12/05/26	257 923	0,09
400 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1.546%, 15/06/26	383 524	0,14	150 000 EUR	CPI Property Group SA, 1.625%, 23/04/27	109 883	0,04
100 000 EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0.632%, 23/10/29	85 559	0,03	10 000 EUR	CPI Property Group SA, 1.625%, 23/04/27	7 326	0,00
200 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 2.250%, 21/11/26	195 404	0,07	270 000 EUR	Czech Gas Networks Investments Sarl, 0.450%, 08/09/29	223 601	0,08
100 000 EUR	Takeda Pharmaceutical Co Ltd, 0.750%, 09/07/27	92 615	0,03	200 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.200%, 18/03/26	187 750	0,07
				100 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.450%, 18/03/28	90 336	0,03
				310 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 0.750%, 18/09/31	261 283	0,09

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Luxembourg (suite)				Luxembourg (suite)			
120 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.350%, 18/09/39	90 641	0,03	200 000 EUR	Richemont International Holding SA, 2.000%, 26/03/38	173 024	0,06
160 000 EUR	DH Europe Finance II Sarl, 1.800%, 18/09/49	116 261	0,04	370 000 EUR	Segro Capital Sarl, 1.250%, 23/03/26	353 801	0,13
230 000 EUR	Eurofins Scientific SE, 0.875%, 19/05/31	187 038	0,07	300 000 EUR	Segro Capital Sarl, 0.500%, 22/09/31	235 689	0,09
300 000 EUR	Grand City Properties SA, 1.375%, 03/08/26	276 456	0,10	240 000 EUR	SELP Finance Sarl, 1.500%, 20/11/25	230 885	0,08
200 000 EUR	Grand City Properties SA, 0.125%, 11/01/28	167 838	0,06	100 000 EUR	SES SA, 1.625%, 22/03/26	95 269	0,04
100 000 EUR	Helvetia Europe SA, 2.750%, 30/09/41	86 655	0,03	100 000 EUR	SES SA, 3.500%, 14/01/29	98 536	0,04
340 000 EUR	Highland Holdings Sarl, 0.318%, 15/12/26	313 694	0,11	100 000 EUR	Simon International Finance SCA, 1.250%, 13/05/25	96 501	0,04
200 000 EUR	John Deere Bank SA, 2.500%, 14/09/26	197 788	0,07	100 000 EUR	Swiss Re Finance Luxembourg SA, 2.534%, 30/04/50	92 631	0,03
100 000 EUR	John Deere Cash Management SARL, 2.200%, 02/04/32	94 401	0,03	300 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 0.125%, 24/03/25	286 839	0,10
300 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.250%, 02/07/25	286 254	0,10	200 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 0.750%, 24/03/29	173 894	0,06
100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.010%, 15/10/25	94 515	0,03	300 000 EUR	Traton Finance Luxembourg SA, 1.250%, 24/03/33	240 579	0,09
175 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.125%, 07/03/27	165 419	0,06	100 000 EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.010%, 14/02/25	96 203	0,04
200 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 0.375%, 15/10/28	177 908	0,06	100 000 EUR	Tyco Electronics Group SA, 0.010%, 16/02/29	86 416	0,03
150 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 3.000%, 15/10/28	150 398	0,05	100 000 EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.250%, 02/11/26	94 501	0,03
430 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.625%, 07/03/31	389 460	0,14	100 000 EUR	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl, 1.100%, 09/11/27	92 213	0,03
150 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.000%, 02/07/31	129 663	0,05	Luxembourg – Total		10 584 625	3,82
200 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 2.250%, 07/03/39	170 456	0,06	Mexique			
100 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.500%, 02/07/39	76 256	0,03	100 000 EUR	America Movil SAB de CV, 0.750%, 26/06/27	92 194	0,03
200 000 EUR	Medtronic Global Holdings SCA, 1.375%, 15/10/40	146 630	0,05	100 000 EUR	America Movil SAB de CV, 2.125%, 10/03/28	95 717	0,04
120 000 EUR	Novartis Finance SA, 1.125%, 30/09/27	114 517	0,04	Mexique – Total		187 911	0,07
370 000 EUR	Novartis Finance SA, 0.010%, 23/09/28	327 346	0,12	Pays-Bas			
100 000 EUR	Novartis Finance SA, 1.375%, 14/08/30	91 880	0,03	100 000 EUR	ABB Finance BV, 0.010%, 19/01/30	84 209	0,03
265 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 0.875%, 09/07/29	232 553	0,08	100 000 EUR	ABB Finance BV, 3.375%, 16/01/31	102 554	0,04
110 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 3.125%, 01/06/31	106 229	0,04	120 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 1.000%, 16/04/25	116 476	0,04
295 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 1.625%, 17/06/32	247 018	0,09	370 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.875%, 22/04/25	357 746	0,13
325 000 EUR	Prologis International Funding II SA, 0.750%, 23/03/33	247 838	0,09	250 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.500%, 15/04/26	236 595	0,09
100 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.000%, 26/03/26	95 872	0,04	200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.875%, 21/12/26	204 074	0,07
200 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.500%, 26/03/30	184 980	0,07	400 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 2.375%, 01/06/27	389 336	0,14
150 000 EUR	Richemont International Holding SA, 1.125%, 26/05/32	129 963	0,05	100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.000%, 16/01/28	102 548	0,04
				100 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.375%, 20/10/28	103 692	0,04
				200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.500%, 23/09/29	169 942	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
300 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.250%, 21/02/30	311 430	0,11	100 000 EUR	BMW Finance NV, 0.375%, 24/09/27	92 187	0,03
200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 3.000%, 01/06/32	195 128	0,07	200 000 EUR	BMW Finance NV, 1.125%, 10/01/28	187 284	0,07
400 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 5.125%, 22/02/33	411 464	0,15	200 000 EUR	BMW Finance NV, 1.500%, 06/02/29	187 036	0,07
200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 5.500%, 21/09/33	209 262	0,08	140 000 EUR	BMW Finance NV, 0.875%, 14/01/32	121 962	0,04
200 000 EUR	ABN AMRO Bank NV, 4.500%, 21/11/34	214 616	0,08	60 000 EUR	BMW Finance NV, 0.200%, 11/01/33	47 260	0,02
300 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 1.250%, 28/05/25	290 826	0,11	100 000 EUR	BMW Finance NV, 4.125%, 04/10/33	107 693	0,04
200 000 EUR	ABN AMRO BANK NV, 1.250%, 20/01/34	161 886	0,06	200 000 EUR	BMW Finance NV, 3.250%, perpetual	201 734	0,07
100 000 EUR	Adecco International Financial Services BV, 1.000%, 02/12/24	97 526	0,04	100 000 EUR	BMW Finance NV, 3.625%, perpetual	103 997	0,04
200 000 EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.125%, 21/09/28	177 206	0,06	200 000 EUR	Brenntag Finance BV, 1.125%, 27/09/25	192 634	0,07
150 000 EUR	Adecco International Financial Services BV, 0.500%, 21/09/31	124 597	0,05	270 000 EUR	Coca-Cola HBC Finance BV, 1.625%, 14/05/31	242 784	0,09
100 000 EUR	Akzo Nobel NV, 1.125%, 08/04/26	95 944	0,03	300 000 EUR	Coloplast Finance BV, 2.250%, 19/05/27	291 135	0,11
100 000 EUR	Akzo Nobel NV, 1.625%, 14/04/30	90 360	0,03	200 000 EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.250%, 30/10/26	186 366	0,07
200 000 EUR	Akzo Nobel NV, 2.000%, 28/03/32	179 474	0,07	480 000 EUR	CTP NV, 0.875%, 20/01/26	445 066	0,16
100 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.875%, 15/01/26	96 119	0,03	290 000 EUR	CTP NV, 0.750%, 18/02/27	258 210	0,09
300 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.010%, 22/11/26	278 370	0,10	310 000 EUR	CTP NV, 1.250%, 21/06/29	256 017	0,09
100 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.500%, 14/01/31	86 257	0,03	100 000 EUR	CTP NV, 1.500%, 27/09/31	77 795	0,03
200 000 EUR	Allianz Finance II BV, 0.500%, 22/11/33	160 754	0,06	250 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 0.625%, 13/12/24	243 257	0,09
200 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.375%, 08/03/28	187 184	0,07	100 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.375%, 01/12/25	97 263	0,04
100 000 EUR	American Medical Systems Europe BV, 1.625%, 08/03/31	90 365	0,03	150 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.375%, 30/01/27	144 217	0,05
200 000 EUR	ASML Holding NV, 3.500%, 06/12/25	201 592	0,07	100 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 3.250%, 17/01/28	102 825	0,04
190 000 EUR	ASML Holding NV, 1.625%, 28/05/27	182 541	0,07	200 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 1.500%, 03/04/28	189 754	0,07
100 000 EUR	ASML Holding NV, 0.625%, 07/05/29	89 488	0,03	100 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 2.000%, 01/12/29	96 785	0,04
100 000 EUR	ASML Holding NV, 0.250%, 25/02/30	85 866	0,03	100 000 EUR	Deutsche Telekom International Finance BV, 7.500%, 24/01/33	134 302	0,05
100 000 EUR	ASR Nederland NV, 3.625%, 12/12/28	101 472	0,04	145 000 EUR	Diageo Capital BV, 0.125%, 28/09/28	127 725	0,05
170 000 EUR	ASR Nederland NV, 3.375%, 02/05/49	157 656	0,06	100 000 EUR	Diageo Capital BV, 1.500%, 08/06/29	93 095	0,03
100 000 EUR	BMW Finance NV, 0.500%, 22/02/25	96 650	0,04	100 000 EUR	Diageo Capital BV, 1.875%, 08/06/34	88 758	0,03
200 000 EUR	BMW Finance NV, 1.000%, 29/08/25	193 318	0,07	200 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 0.625%, 15/07/25	189 468	0,07
50 000 EUR	BMW Finance NV, 0.010%, 11/01/26	47 200	0,02	200 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 1.500%, 15/03/30	174 060	0,06
250 000 EUR	BMW Finance NV, 1.125%, 22/05/26	239 662	0,09	300 000 EUR	Digital Dutch Finco BV, 1.000%, 15/01/32	238 947	0,09
100 000 EUR	BMW Finance NV, 0.375%, 14/01/27	93 316	0,03	150 000 EUR	Digital Intrepid Holding BV, 0.625%, 15/07/31	117 679	0,04
				100 000 EUR	DSM BV, 0.750%, 28/09/26	95 028	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
100 000 EUR	DSM BV, 0.250%, 23/06/28	90 013	0,03	100 000 EUR	Ing Groep NV, 1.750%, 16/02/31	89 378	0,03
70 000 EUR	DSM BV, 0.625%, 23/06/32	57 803	0,02	200 000 EUR	ING Groep NV, 2.125%, 10/01/26	195 894	0,07
130 000 EUR	DSV Finance BV, 0.500%, 03/03/31	108 700	0,04	400 000 EUR	ING Groep NV, 2.125%, 23/05/26	391 352	0,14
200 000 EUR	DSV Finance BV, 0.750%, 05/07/33	159 592	0,06	100 000 EUR	ING Groep NV, 1.250%, 16/02/27	95 107	0,03
100 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.000%, 13/04/25	96 970	0,04	300 000 EUR	ING Groep NV, 4.875%, 14/11/27	311 142	0,11
220 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.625%, 30/05/26	213 730	0,08	200 000 EUR	ING Groep NV, 1.375%, 11/01/28	188 150	0,07
200 000 EUR	E.ON International Finance BV, 1.250%, 19/10/27	188 048	0,07	400 000 EUR	ING Groep NV, 2.000%, 20/09/28	380 224	0,14
150 000 EUR	E.ON International Finance BV, 5.750%, 14/02/33	178 675	0,06	100 000 EUR	ING Groep NV, 0.375%, 29/09/28	88 767	0,03
400 000 EUR	Edp Finance BV, 1.875%, 21/09/29	373 540	0,14	100 000 EUR	ING Groep NV, 0.250%, 01/02/30	84 329	0,03
340 000 EUR	EDP Finance BV, 1.875%, 13/10/25	332 296	0,12	300 000 EUR	ING Groep NV, 2.000%, 22/03/30	290 115	0,11
190 000 EUR	EDP Finance BV, 0.375%, 16/09/26	177 027	0,06	500 000 EUR	ING Groep NV, 2.500%, 15/11/30	478 695	0,17
100 000 EUR	EDP Finance BV, 3.875%, 11/03/30	103 447	0,04	300 000 EUR	ING Groep NV, 0.875%, 29/11/30	256 176	0,09
400 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.500%, 21/07/25	388 560	0,14	500 000 EUR	ING Groep NV, 2.125%, 26/05/31	476 990	0,17
240 000 EUR	Enel Finance International NV, 1.125%, 16/09/26	228 190	0,08	200 000 EUR	ING Groep NV, 4.125%, 24/08/33	200 670	0,07
100 000 EUR	Euronext NV, 1.125%, 12/06/29	91 307	0,03	100 000 EUR	ING Groep NV, 0.250%, perpetual	86 774	0,03
350 000 EUR	Euronext NV, 1.500%, 17/05/41	262 913	0,10	200 000 EUR	ING Groep NV, 4.500%, perpetual	206 126	0,07
100 000 EUR	Givaudan Finance Europe BV, 1.000%, 22/04/27	94 869	0,03	200 000 EUR	ING Groep NV, 4.750%, perpetual	212 778	0,08
100 000 EUR	Givaudan Finance Europe BV, 1.625%, 22/04/32	89 342	0,03	100 000 EUR	ISS Finance BV, 1.250%, 07/07/25	96 214	0,04
200 000 EUR	Global Switch Finance BV, 1.375%, 07/10/30	180 704	0,07	100 000 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1.125%, 19/03/26	96 350	0,04
300 000 EUR	H&M Finance BV, 4.875%, 25/10/31	320 499	0,12	200 000 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 3.500%, 04/04/28	204 154	0,07
100 000 EUR	Heineken NV, 1.625%, 30/03/25	97 885	0,04	200 000 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0.375%, 18/03/30	169 340	0,06
100 000 EUR	Heineken NV, 1.000%, 04/05/26	95 389	0,03	100 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 0.625%, 09/04/25	96 428	0,04
260 000 EUR	Heineken NV, 1.250%, 17/03/27	245 864	0,09	100 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 1.125%, 11/09/28	92 282	0,03
100 000 EUR	Heineken NV, 1.500%, 03/10/29	92 376	0,03	200 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 3.875%, 03/07/31	207 378	0,08
250 000 EUR	Heineken NV, 2.250%, 30/03/30	239 680	0,09	100 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 0.500%, 22/05/26	93 234	0,03
100 000 EUR	Heineken NV, 1.750%, 17/03/31	91 699	0,03	200 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 2.000%, 30/03/30	181 862	0,07
200 000 EUR	Heineken NV, 4.125%, 23/03/35	214 412	0,08	100 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 4.250%, 08/09/31	102 397	0,04
100 000 EUR	Heineken NV, 1.750%, 07/05/40	80 425	0,03	100 000 EUR	Koninklijke Philips NV, 2.625%, 05/05/33	89 693	0,03
300 000 EUR	Iberdrola International BV, 0.375%, 15/09/25	286 716	0,10	200 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 3.500%, 09/04/25	199 846	0,07
500 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.125%, 21/04/26	481 925	0,17	300 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 0.250%, 23/02/26	279 531	0,10
300 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.450%, perpetual	273 078	0,10	200 000 EUR	LeasePlan Corp NV, 0.250%, 07/09/26	183 724	0,07
400 000 EUR	Iberdrola International BV, 1.825%, perpetual	340 564	0,12	100 000 EUR	Lseg Netherlands BV, 0.010%, 06/04/25	95 852	0,03
400 000 EUR	Iberdrola International BV, 3.250%, perpetual	394 892	0,14	200 000 EUR	Lseg Netherlands BV, 0.250%, 06/04/28	178 294	0,06
140 000 EUR	IMCD NV, 2.125%, 31/03/27	133 790	0,05	100 000 EUR	Lseg Netherlands BV, 0.750%, 06/04/33	80 399	0,03
160 000 EUR	IMCD NV, 4.875%, 18/09/28	167 707	0,06	100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.625%, 16/12/24	99 828	0,04
				150 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.000%, 11/11/25	143 964	0,05
				100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.375%, 26/06/26	96 057	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
100 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 1.500%, 09/02/27	96 094	0,03	100 000 EUR	Ren Finance BV, 0.500%, 16/04/29	87 698	0,03
250 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 0.625%, 06/05/27	232 752	0,08	100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.312%, 04/12/27	102 354	0,04
400 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.500%, perpetual	404 252	0,15	200 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.204%, 27/08/29	205 278	0,07
350 000 EUR	Mercedes-Benz International Finance BV, 3.700%, perpetual	365 827	0,13	100 000 EUR	Roche Finance Europe BV, 3.586%, 04/12/36	105 765	0,04
125 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.010%, 22/09/26	115 662	0,04	100 000 EUR	Sagax Euro Mtn NL BV, 1.000%, 17/05/29	81 752	0,03
450 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.250%, 09/09/29	387 616	0,14	100 000 EUR	Sartorius Finance BV, 4.375%, 14/09/29	103 615	0,04
100 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.875%, 01/10/31	84 775	0,03	100 000 EUR	Sartorius Finance BV, 4.500%, 14/09/32	104 142	0,04
100 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 0.625%, 09/09/32	80 720	0,03	100 000 EUR	Sartorius Finance BV, 4.875%, 14/09/35	105 440	0,04
150 000 EUR	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 1.250%, 09/09/41	106 232	0,04	300 000 EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.250%, 05/04/29	292 137	0,11
300 000 EUR	Nationale-Nederlanden Bank NV Netherlands, 0.500%, 21/09/28	264 630	0,10	300 000 EUR	Siemens Energy Finance BV, 4.000%, perpetual	296 040	0,11
300 000 EUR	Naturgy Finance BV, 0.875%, 15/05/25	289 224	0,10	200 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.250%, 10/03/25	197 358	0,07
300 000 EUR	Ne Property BV, 2.000%, 20/01/30	241 668	0,09	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.010%, 20/02/26	94 211	0,03
100 000 EUR	NE Property BV, 3.375%, 14/07/27	94 194	0,03	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.010%, 20/02/26	94 336	0,03
400 000 EUR	Nibc Bank Nv, 0.250%, 09/09/26	365 812	0,13	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.375%, 05/06/26	186 944	0,07
100 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.875%, 08/07/25	95 626	0,03	200 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.900%, 28/02/28	101 136	0,04
100 000 EUR	NIBC Bank NV, 0.875%, 24/06/27	91 077	0,03	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2.875%, 10/03/28	176 636	0,06
250 000 EUR	NN Group NV, 6.000%, 03/11/43	266 480	0,10	200 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.250%, 20/02/29	91 769	0,03
310 000 EUR	NN Group NV, 4.625%, 13/01/48	310 651	0,11	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.375%, 06/09/30	334 336	0,12
200 000 EUR	NN Group NV, 4.500%, perpetual	199 210	0,07	370 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.250%, 28/02/31	165 616	0,06
200 000 EUR	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 1.375%, 31/03/30	185 888	0,07	200 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.500%, 20/02/32	233 310	0,08
270 000 EUR	PACCAR Financial Europe BV, 0.010%, 01/03/26	252 301	0,09	300 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0.500%, 05/09/34	103 445	0,04
100 000 EUR	PACCAR Financial Europe BV, 3.375%, perpetual	100 974	0,04	100 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3.500%, 24/02/36	290 115	0,11
100 000 EUR	PostNL NV, 0.625%, 23/09/26	92 582	0,03	350 000 EUR	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1.750%, 28/02/39	135 765	0,05
100 000 EUR	Prosus NV, 1.539%, 03/08/28	86 264	0,03	140 000 EUR	Signify NV, 2.375%, 11/05/27	101 656	0,04
200 000 EUR	Prosus NV, 1.288%, 13/07/29	162 484	0,06	100 000 EUR	Sika Capital BV, 3.750%, 03/11/26		
100 000 EUR	Prosus NV, 2.031%, 03/08/32	76 660	0,03				
150 000 EUR	Prosus NV, 1.985%, 13/07/33	110 811	0,04				
100 000 EUR	Prosus NV, 2.778%, 19/01/34	77 963	0,03				
100 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.375%, 19/05/26	94 308	0,03				
250 000 EUR	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV, 0.750%, 19/05/30	219 000	0,08				
150 000 EUR	RELX Finance BV, 1.375%, 12/05/26	144 915	0,05				
100 000 EUR	RELX Finance BV, 1.500%, 13/05/27	95 732	0,03				
100 000 EUR	RELX Finance BV, 0.500%, 10/03/28	90 687	0,03				
100 000 EUR	Ren Finance BV, 1.750%, 18/01/28	94 844	0,03				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
100 000	EUR Sika Capital BV, 0.875%, 29/04/27	93 451	0,03	400 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 1.875%, 30/03/27	382 328	0,14
100 000	EUR Sika Capital BV, 1.500%, 29/04/31	90 017	0,03	200 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 3.750%, 28/09/27	202 876	0,07
100 000	EUR Stellantis NV, 3.875%, 05/01/26	100 851	0,04	200 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 4.250%, 15/02/28	206 448	0,07
150 000	EUR Stellantis NV, 0.625%, 30/03/27	138 225	0,05	400 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 0.875%, 22/09/28	357 968	0,13
100 000	EUR Stellantis NV, 4.500%, 07/07/28	105 282	0,04	100 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 1.625%, 16/01/30	90 439	0,03
100 000	EUR Stellantis NV, 0.750%, 18/01/29	88 858	0,03	400 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 4.375%, 15/05/30	391 314	0,15
400 000	EUR Stellantis NV, 4.375%, 14/03/30	422 484	0,15	200 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 3.250%, 18/11/30	197 852	0,07
150 000	EUR Stellantis NV, 4.250%, 16/06/31	155 634	0,06	400 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 1.250%, 23/09/32	332 864	0,12
150 000	EUR Stellantis NV, 2.750%, 01/04/32	140 292	0,05	100 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 3.300%, 22/03/33	98 629	0,04
300 000	EUR Stellantis NV, 1.250%, 20/06/33	241 662	0,09	100 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 4.125%, 16/11/38	103 530	0,04
50 000	EUR Telefonica Europe BV, 5.875%, 14/02/33	60 033	0,02	150 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 4.625%, perpetual	148 729	0,05
100 000	EUR Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.010%, 18/11/25	94 354	0,03	100 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 3.748%, perpetual	93 666	0,03
300 000	EUR Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 0.800%, 18/10/30	260 373	0,09	200 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 4.625%, perpetual	190 544	0,07
400 000	EUR Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 1.125%, 18/10/33	332 160	0,12	300 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 4.625%, perpetual	290 646	0,11
150 000	EUR Toyota Motor Finance Netherlands BV, 0.010%, 27/10/25	141 624	0,05	300 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 7.875%, perpetual	326 223	0,12
100 000	EUR Toyota Motor Finance Netherlands BV, 4.000%, 02/04/27	103 058	0,04	200 000	EUR VolkswAGEN International Finance NV, 3.500%, perpetual	225 048	0,08
100 000	EUR Unilever Finance Netherlands BV, 1.250%, 25/03/25	97 502	0,04	200 000	EUR VolkswAGEN International Finance NV, 3.875%, perpetual	194 516	0,07
270 000	EUR Unilever Finance Netherlands BV, 0.875%, 31/07/25	260 893	0,09	300 000	EUR Vonovia Finance BV, 1.250%, 06/12/24	194 876	0,07
100 000	EUR Unilever Finance Netherlands BV, 0.750%, 28/02/26	95 555	0,03	400 000	EUR Vonovia Finance BV, 1.500%, 10/06/26	381 548	0,14
100 000	EUR Unilever Finance Netherlands BV, 1.125%, 12/02/27	95 178	0,03	300 000	EUR Vonovia Finance BV, 1.500%, 14/01/28	274 761	0,10
200 000	EUR Unilever Finance Netherlands BV, 1.000%, 14/02/27	189 624	0,07	300 000	EUR Vonovia Finance BV, 2.125%, 22/03/30	268 512	0,10
270 000	EUR Unilever Finance Netherlands BV, 1.750%, 25/03/30	253 357	0,09	100 000	EUR Vonovia Finance BV, 1.125%, 14/09/34	74 573	0,03
100 000	EUR Unilever Finance Netherlands BV, 1.375%, 04/09/30	91 296	0,03	100 000	EUR Vonovia Finance BV, 1.000%, 28/01/41	59 636	0,02
100 000	EUR Universal Music Group NV, 4.000%, 13/06/31	104 507	0,04	320 000	EUR Wabtec Transportation Netherlands BV, 1.250%, 03/12/27	294 861	0,11
100 000	EUR Universal Music Group NV, 3.750%, 30/06/32	103 001	0,04	100 000	EUR Wolters Kluwer NV, 1.500%, 22/03/27	95 573	0,03
100 000	EUR Upjohn Finance BV, 1.362%, 23/06/27	92 842	0,03	100 000	EUR Wolters Kluwer NV, 0.750%, 03/07/30	86 825	0,03
240 000	EUR Upjohn Finance BV, 1.908%, 23/06/32	201 554	0,07				
100 000	EUR Utah Acquisition Sub Inc, 3.125%, 22/11/28	97 401	0,04	Pays-Bas – Total		46 630 581	16,85
200 000	EUR Vesteda Finance BV, 1.500%, 24/05/27	188 596	0,07				
200 000	EUR Vesteda Finance BV, 0.750%, 18/10/31	160 502	0,06				
200 000	EUR Via Outlets BV, 1.750%, 15/11/28	177 644	0,06				
300 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 4.125%, 15/11/25	303 732	0,11				
200 000	EUR Volkswagen International Finance NV, 3.875%, 29/03/26	201 480	0,07				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Nouvelle-Zélande				Espagne			
200 000 EUR	ASB Bank Ltd, 4.500%, 16/03/27	206 460	0,07	100 000 EUR	Abanca Corp Bancaria SA, 0.500%, 08/09/27	91 279	0,03
110 000 EUR	ASB Bank Ltd, 0.250%, 08/09/28	95 886	0,04	200 000 EUR	Abanca Corp Bancaria SA, 5.250%, 14/09/28	207 370	0,08
100 000 EUR	ASB Bank Ltd, 0.500%, 24/09/29	86 187	0,03	200 000 EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 0.375%, 07/10/27	179 238	0,06
Nouvelle-Zélande – Total				Nouvelle-Zélande – Total			
		388 533	0,14				
Norvège				Norvège			
130 000 EUR	DNB Bank ASA, 3.625%, 16/02/27	130 409	0,05	100 000 EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 3.750%, 25/04/30	98 714	0,04
880 000 EUR	DNB Bank ASA, 3.125%, 21/09/27	877 202	0,32	200 000 EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1.375%, 26/01/32	167 634	0,06
330 000 EUR	DNB Bank ASA, 0.375%, 18/01/28	302 379	0,11	400 000 EUR	ACS Servicios Comunicaciones y Energia SA, 1.875%, 20/04/26	387 152	0,14
200 000 EUR	DNB Bank ASA, 4.500%, 19/07/28	206 686	0,07	200 000 EUR	Amadeus IT Group SA, 2.875%, 20/05/27	198 250	0,07
220 000 EUR	DNB Bank ASA, 0.250%, 23/02/29	192 973	0,07	100 000 EUR	Amadeus IT Group SA, 1.875%, 24/09/28	95 394	0,03
100 000 EUR	DNB Bank ASA, 5.000%, 13/09/33	104 100	0,04	500 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.375%, 14/05/25	485 035	0,18
250 000 EUR	DNB Bank ASA, 4.000%, perpetual	257 667	0,09	200 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.750%, 04/06/25	192 762	0,07
100 000 EUR	Santander Consumer Bank AS, 0.500%, 11/08/25	95 068	0,03	300 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.000%, 21/06/26	284 931	0,10
100 000 EUR	Santander Consumer Bank AS, 0.125%, perpetual	92 658	0,03	400 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3.500%, 10/02/27	400 444	0,14
200 000 EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 1.750%, 27/04/27	190 204	0,07	400 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0.125%, 24/03/27	372 468	0,13
200 000 EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 0.125%, 03/03/28	175 750	0,06	100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.625%, 13/01/31	104 892	0,04
330 000 EUR	SpareBank 1 SMN, 0.010%, 18/02/28	289 826	0,11	100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5.750%, 15/09/33	105 169	0,04
200 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 2.875%, 20/09/25	198 180	0,07	100 000 EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.125%, perpetual	100 638	0,04
490 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.250%, 09/11/26	450 261	0,16	200 000 EUR	BanCo Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4.375%, 14/10/29	212 436	0,08
290 000 EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.375%, 15/07/27	265 756	0,10	200 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 1.125%, 11/03/27	189 810	0,06
100 000 EUR	Storebrand Livsforsikring AS, 1.875%, 30/09/51	79 675	0,03	100 000 EUR	Banco de Sabadell SA, 5.000%, 07/06/29	105 112	0,04
Norvège – Total				Norvège – Total			
		3 908 794	1,41				
Pologne				Pologne			
200 000 EUR	ORLEN SA, 1.125%, 27/05/28	180 380	0,06	200 000 EUR	Banco De SABadell SA, 0.875%, 22/07/25	192 480	0,07
Pologne – Total				Pologne – Total			
		180 380	0,06				
Portugal				Portugal			
200 000 EUR	Banco Comercial Portugues SA, 1.125%, 12/02/27	189 064	0,07	100 000 EUR	Banco Santander SA, 1.125%, 17/01/25	97 296	0,04
100 000 EUR	EDP - Energias de Portugal SA, 1.625%, 15/04/27	95 685	0,03	400 000 EUR	Banco Santander SA, 2.500%, 18/03/25	394 480	0,14
200 000 EUR	EDP - Energias de Portugal SA, 3.875%, 26/06/28	205 540	0,07	100 000 EUR	Banco Santander SA, 1.375%, 05/01/26	95 915	0,03
200 000 EUR	Floene Energias SA, 4.875%, 03/07/28	207 404	0,08	100 000 EUR	Banco Santander SA, 3.250%, 04/04/26	99 373	0,04
Portugal – Total				Portugal – Total			
		697 693	0,25				
Roumanie				Roumanie			
100 000 EUR	Banca Comerciala Romana SA, 7.625%, perpetual	105 584	0,04	300 000 EUR	Banco Santander SA, 0.300%, 04/10/26	278 715	0,10
Roumanie – Total				Roumanie – Total			
		105 584	0,04				
Slovaquie				Slovaquie			
300 000 EUR	Tatra Banka as, 0.500%, 23/04/28	254 997	0,09	400 000 EUR	Banco Santander SA, 1.125%, 23/06/27	373 300	0,14
Slovaquie – Total				Slovaquie – Total			
		254 997	0,09				
				100 000 EUR	Banco Santander SA, 4.625%, 18/10/27	102 453	0,04

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Espagne (suite)				Espagne (suite)			
500 000 EUR	Banco Santander SA, 0.200%, 11/02/28	442 190	0,16	200 000 EUR	Mapfre SA, 1.625%, 19/05/26	195 654	0,07
300 000 EUR	Banco Santander SA, 0.625%, 24/06/29	265 611	0,10	100 000 EUR	Mapfre SA, 4.375%, 31/03/47	98 550	0,04
100 000 EUR	Banco Santander SA, 4.250%, 12/06/30	104 489	0,04	200 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 2.375%, 13/07/27	192 506	0,07
100 000 EUR	Banco Santander SA, 1.625%, 22/10/30	86 133	0,03	100 000 EUR	Merlin Properties Socimi SA, 1.375%, 01/06/30	84 780	0,03
400 000 EUR	Banco Santander SA, 4.875%, 18/10/31	425 924	0,15	200 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.375%, 24/07/28	180 888	0,07
300 000 EUR	Banco Santander SA, 1.000%, 04/11/31	256 905	0,09	500 000 EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.500%, 24/05/33	409 850	0,15
200 000 EUR	Banco Santander SA, 5.750%, perpetual	209 714	0,08	200 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.375%, 17/01/25	193 394	0,07
400 000 EUR	Bankinter SA, 0.875%, 08/07/26	376 220	0,14	100 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.010%, 23/02/26	93 304	0,03
100 000 EUR	Bankinter SA, 0.625%, 06/10/27	91 016	0,03	300 000 EUR	Santander Consumer Finance SA, 0.500%, 14/11/26	277 422	0,10
200 000 EUR	CaixaBank SA, 0.375%, 03/02/25	193 104	0,07	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.528%, 17/01/25	97 841	0,04
100 000 EUR	CaixaBank SA, 1.375%, 19/06/26	94 968	0,03	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.495%, 11/09/25	97 176	0,04
200 000 EUR	CaixaBank SA, 0.750%, 09/07/26	187 902	0,07	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.460%, 13/04/26	96 511	0,03
400 000 EUR	CaixaBank SA, 0.750%, 10/07/26	384 412	0,14	300 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.447%, 22/01/27	286 164	0,10
300 000 EUR	CaixaBank SA, 0.375%, 18/11/26	282 351	0,10	300 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.201%, 21/08/27	279 996	0,10
200 000 EUR	CaixaBank SA, 0.500%, 09/02/29	176 286	0,06	300 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.201%, 21/08/27	279 996	0,10
300 000 EUR	CaixaBank SA, 5.000%, 19/07/29	313 662	0,11	400 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.715%, 12/01/28	378 376	0,14
400 000 EUR	CaixaBank SA, 3.750%, 07/09/29	410 244	0,15	300 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.788%, 12/03/29	282 459	0,10
500 000 EUR	CaixaBank SA, 2.250%, 17/04/30	482 740	0,17	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.957%, 01/07/39	80 179	0,03
200 000 EUR	CaixaBank SA, 5.375%, 14/11/30	539 475	0,20	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 1.864%, 13/07/40	78 041	0,03
200 000 EUR	CaixaBank SA, 1.250%, 18/06/31	186 148	0,07	100 000 EUR	Telefonica Emisiones SA, 2.932%, perpetual	98 922	0,04
200 000 EUR	CaixaBank SA, 1.250%, 18/06/31	186 148	0,07	300 000 EUR	Unicaja Banco SA, 1.000%, 01/12/26	283 440	0,10
100 000 EUR	CaixaBank SA, 5.125%, 19/07/34	106 711	0,04				
300 000 EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 4.125%, 04/04/29	312 288	0,11	Espagne – Total		18 970 069	6,85
220 000 EUR	EDP Servicios Financieros Espana SA, 4.375%, 04/04/32	234 432	0,08	Suède			
200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.000%, 07/03/25	194 394	0,07	200 000 EUR	Alfa Laval Treasury International AB, 0.875%, 18/02/26	191 082	0,07
300 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.250%, 28/10/26	287 952	0,10	200 000 EUR	Assa Abloy AB, 3.875%, 13/09/30	210 006	0,08
200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.250%, 13/09/27	190 860	0,07	300 000 EUR	Atlas Copco AB, 0.625%, 30/08/26	283 086	0,10
300 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.375%, 11/03/32	266 118	0,10	100 000 EUR	Electrolux AB, 2.500%, 18/05/30	91 838	0,03
300 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 3.375%, 22/11/32	306 024	0,11	130 000 EUR	EQT AB, 2.875%, 06/04/32	115 600	0,04
200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 0.875%, perpetual	192 884	0,07	200 000 EUR	Investor AB, 0.375%, 29/10/35	144 872	0,05
200 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 4.875%, perpetual	201 784	0,07	80 000 EUR	Investor AB, 1.500%, 20/06/39	60 781	0,02
300 000 EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.575%, perpetual	267 228	0,10				
300 000 EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 1.625%, 28/11/25	290 079	0,10	100 000 EUR	Molnlycke Holding AB, 1.875%, 28/02/25	97 666	0,03
100 000 EUR	Inmobiliaria Colonial Socimi SA, 1.350%, 14/10/28	92 226	0,03	100 000 EUR	Molnlycke Holding AB, 0.875%, 05/09/29	86 109	0,03
200 000 EUR	Kutxabank SA, 4.750%, 15/06/27	203 516	0,07	270 000 EUR	Molnlycke Holding AB, 0.625%, 15/01/31	218 284	0,08
300 000 EUR	Lar Espana Real Estate Socimi SA, 1.750%, 22/07/26	269 397	0,10				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Suède (suite)				Suède (suite)			
110 000	EUR Nordea Bank Abp, 1.125%, 12/02/25	107 209	0,04	360 000	EUR Volvo Treasury AB, 0.010%, 18/05/26	334 660	0,12
300 000	EUR Sandvik AB, 3.000%, 18/06/26	297 099	0,11	180 000	EUR Volvo Treasury AB, 2.000%, 19/08/27	173 822	0,06
100 000	EUR Sandvik AB, 0.375%, 25/11/28	87 986	0,03				
200 000	EUR Securitas AB, 1.250%, 06/03/25	193 622	0,07	Suède – Total			
100 000	EUR Securitas AB, 0.250%, 22/02/28	88 114	0,03	9 545 959			
400 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.000%, 09/11/26	406 992	0,15	3,45			
100 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1.750%, 11/11/26	96 034	0,03	Royaume-Uni			
200 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.375%, 11/02/27	182 296	0,07	100 000	EUR 3i Group PLC, 4.875%, 14/06/29	104 513	0,04
350 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.125%, 29/06/27	360 507	0,13	200 000	EUR ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.200%, 23/09/27	178 868	0,06
200 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.750%, 09/08/27	181 936	0,07	100 000	EUR Aon Global Ltd, 2.875%, 14/05/26	98 360	0,04
200 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.375%, 21/06/28	174 842	0,06	200 000	EUR AstraZeneca PLC, 1.250%, 12/05/28	188 158	0,07
100 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4.375%, 06/11/28	103 742	0,04	100 000	EUR AstraZeneca PLC, 3.750%, perpetual	105 270	0,04
420 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.750%, 03/11/31	382 305	0,14	100 000	EUR Aviva PLC, 3.375%, 04/12/45	97 497	0,04
100 000	EUR Skandinaviska Enskilda Banken AB, 3.875%, perpetual	102 412	0,04	200 000	EUR Barclays PLC, 0.877%, 28/01/28	183 598	0,07
100 000	EUR SKF AB, 0.250%, 15/02/31	79 617	0,03	230 000	EUR Barclays PLC, 0.577%, 09/08/29	197 972	0,07
320 000	EUR Svenska Handelsbanken AB, 1.000%, 15/04/25	310 493	0,11	200 000	EUR Barclays PLC, 4.918%, 08/08/30	208 480	0,08
300 000	EUR Svenska Handelsbanken AB, 0.050%, 03/09/26	275 922	0,10	200 000	EUR Barclays PLC, 1.125%, 22/03/31	184 274	0,07
300 000	EUR Svenska Handelsbanken AB, 3.875%, 10/05/27	306 135	0,11	100 000	EUR Barclays PLC, 1.106%, 12/05/32	81 530	0,03
100 000	EUR Svenska Handelsbanken AB, 0.010%, 02/12/27	88 463	0,03	200 000	EUR Barclays PLC, 5.262%, 29/01/34	214 128	0,08
320 000	EUR Svenska Handelsbanken AB, 0.050%, 06/09/28	278 474	0,10	70 000	EUR Brambles Finance PLC, 1.500%, 04/10/27	65 959	0,02
200 000	EUR Svenska Handelsbanken AB, 2.625%, 05/09/29	195 350	0,07	200 000	EUR Brambles Finance PLC, 4.250%, 22/03/31	210 902	0,08
100 000	EUR Swedbank AB, 0.250%, 02/11/26	92 280	0,03	100 000	EUR British Telecommunications PLC, 0.500%, 12/09/25	95 265	0,03
390 000	EUR Swedbank AB, 2.100%, 25/05/27	375 387	0,14	200 000	EUR British Telecommunications PLC, 1.750%, 10/03/26	193 990	0,07
360 000	EUR Swedbank AB, 0.200%, 12/01/28	313 841	0,11	100 000	EUR British Telecommunications PLC, 1.500%, 23/06/27	94 578	0,03
500 000	EUR Swedbank AB, 4.250%, 11/07/28	513 690	0,19	100 000	EUR British Telecommunications PLC, 2.125%, 26/09/28	95 844	0,03
100 000	EUR Swedbank AB, 4.625%, perpetual	101 049	0,04	100 000	EUR British Telecommunications PLC, 1.125%, 12/09/29	89 733	0,03
200 000	EUR Tele2 AB, 2.125%, 15/05/28	191 486	0,07	200 000	EUR British Telecommunications PLC, 3.750%, 13/05/31	205 614	0,07
200 000	EUR Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 5.375%, 29/05/28	208 998	0,08	100 000	EUR British Telecommunications PLC, 3.375%, 30/08/32	100 008	0,04
240 000	EUR Telia Co AB, 3.875%, 01/10/25	242 815	0,09	200 000	EUR Cadent Finance PLC, 4.250%, 05/07/29	208 798	0,08
100 000	EUR Telia Co AB, 2.125%, 20/02/34	90 197	0,03	200 000	EUR Cadent Finance PLC, 0.625%, 19/03/30	168 436	0,06
100 000	EUR Telia Co AB, 1.625%, 23/02/35	84 525	0,03	200 000	EUR Cadent Finance PLC, 0.750%, 11/03/32	161 376	0,06
300 000	EUR Telia Co AB, 4.625%, 21/12/82	299 229	0,11	100 000	EUR Coca-Cola Europacific Partners PLC, 0.200%, 02/12/28	87 262	0,03
100 000	EUR Telia Co AB, 2.750%, 30/06/83	92 001	0,03	300 000	EUR Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1.125%, 12/04/29	272 103	0,10
260 000	EUR Volvo Treasury AB, 2.625%, 20/02/26	256 963	0,09	100 000	EUR Coca-Cola Europacific Partners PLC, 0.700%, 12/09/31	83 682	0,03
				200 000	EUR Diageo Finance PLC, 2.375%, 20/05/26	195 224	0,07
				100 000	EUR Diageo Finance PLC, 1.875%, 27/03/27	96 788	0,04

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
100 000 EUR	Diageo Finance PLC, 2.500%, 27/03/32	95 875	0,03	100 000 EUR	London Stock Exchange Group PLC, 1.750%, 19/09/29	93 494	0,03
350 000 EUR	DS Smith PLC, 4.500%, 27/07/30	364 626	0,13	100 000 EUR	Mobico Group PLC, 4.875%, 26/09/31	101 634	0,04
150 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.375%, 02/12/24	146 943	0,05	100 000 EUR	National Grid Electricity Transmission PLC, 0.190%, 20/01/25	96 462	0,03
100 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 4.000%, 16/06/25	100 973	0,04	250 000 EUR	National Grid PLC, 0.250%, 01/09/28	218 302	0,08
100 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.250%, 21/05/26	96 211	0,03	200 000 EUR	National Grid PLC, 3.875%, 16/01/29	205 588	0,07
100 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.000%, 12/09/26	95 339	0,03	460 000 EUR	Nationwide Building Society, 1.500%, 08/03/26	447 700	0,16
200 000 EUR	GlaxoSmithKline Capital PLC, 1.750%, 21/05/30	187 342	0,07	200 000 EUR	Nationwide Building Society, 2.000%, 28/04/27	192 310	0,07
200 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.000%, 30/06/25	197 932	0,07	530 000 EUR	Natwest Group PLC, 0.780%, 26/02/30	456 409	0,16
100 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 2.500%, 15/03/27	98 083	0,04	540 000 EUR	NatWest Group PLC, 4.067%, 06/09/28	549 893	0,20
450 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.019%, 15/06/27	444 483	0,16	100 000 EUR	NatWest Group PLC, 5.763%, 28/02/34	105 209	0,04
140 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 3.125%, 07/06/28	137 648	0,05	300 000 EUR	NatWest Markets PLC, 2.750%, 02/04/25	297 225	0,11
100 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 0.770%, 13/11/31	83 819	0,03	390 000 EUR	NatWest Markets PLC, 4.250%, 13/01/28	403 108	0,15
300 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.787%, 10/03/32	317 187	0,11	100 000 EUR	Omnicom Finance Holdings PLC, 0.800%, 08/07/27	92 393	0,03
280 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 6.364%, 16/11/32	301 294	0,11	200 000 EUR	Ote PLC, 0.875%, 24/09/26	187 734	0,07
200 000 EUR	HSBC Holdings PLC, 4.856%, perpetual	212 032	0,08	100 000 EUR	Phoenix Group Holdings PLC, 4.375%, 24/01/29	95 661	0,03
370 000 EUR	Informa PLC, 2.125%, 06/10/25	359 522	0,13	350 000 EUR	Rentokil Initial PLC, 0.500%, 14/10/28	310 037	0,11
210 000 EUR	Intermediate Capital Group PLC, 2.500%, 28/01/30	184 932	0,07	280 000 EUR	Sage Group PLC, 3.820%, perpetual	287 974	0,10
100 000 EUR	International Distributions Services PLC, 1.250%, 08/10/26	93 394	0,03	200 000 EUR	Santander UK PLC, 1.125%, 10/03/25	193 920	0,07
110 000 EUR	Investec Bank PLC, 1.250%, 11/08/26	103 167	0,04	150 000 EUR	Sky Ltd, 2.250%, 17/11/25	147 470	0,05
120 000 EUR	Investec Bank PLC, 0.500%, 17/02/27	109 684	0,04	100 000 EUR	Sky Ltd, 2.500%, 15/09/26	98 522	0,04
120 000 EUR	ITV PLC, 1.375%, 26/09/26	112 919	0,04	260 000 EUR	SSE PLC, 0.875%, 06/09/25	249 740	0,09
100 000 EUR	Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 0.375%, 28/01/25	96 529	0,03	200 000 EUR	SSE PLC, 1.375%, 04/09/27	189 016	0,07
100 000 EUR	Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 2.375%, 09/04/26	98 214	0,04	200 000 EUR	SSE PLC, 2.875%, 01/08/29	197 814	0,07
100 000 EUR	Lloyds Bank Corporate Markets PLC, 4.125%, perpetual	102 364	0,04	330 000 EUR	SSE PLC, 4.000%, 05/09/31	344 959	0,12
200 000 EUR	Lloyds Bank PLC, 1.250%, 13/01/25	194 806	0,07	100 000 EUR	Standard Chartered PLC, 0.900%, 02/07/27	93 432	0,03
200 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 3.500%, 01/04/26	199 398	0,07	250 000 EUR	Standard Chartered PLC, 2.500%, 09/09/30	241 965	0,09
100 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 1.500%, 12/09/27	94 483	0,03	70 000 EUR	Standard Chartered PLC, 1.200%, 23/09/31	63 497	0,02
100 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 4.500%, 18/03/30	99 742	0,04	200 000 EUR	Standard Chartered PLC, 4.874%, perpetual	209 296	0,08
150 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 3.125%, 24/08/30	145 994	0,05	200 000 EUR	Tesco Corporate Treasury Services PLC, 0.875%, 29/05/26	189 436	0,07
100 000 EUR	Lloyds Banking Group PLC, 4.750%, 21/09/31	105 656	0,04	200 000 EUR	Tesco Corporate Treasury Services PLC, 0.375%, 27/07/29	169 942	0,06
				200 000 EUR	Tesco Corporate Treasury Services PLC, 4.250%, perpetual	207 814	0,08

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				États-Unis (suite)			
200 000 EUR	Tritax EuroBox PLC, 0.950%, 02/06/26	181 934	0,07	100 000 EUR	Athene Global Funding, 0.625%, 12/01/28	88 981	0,03
370 000 EUR	Unilever PLC, 1.500%, 11/06/39	300 188	0,11	360 000 EUR	Autoliv Inc, 4.250%, 15/03/28	369 238	0,13
200 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.125%, 20/11/25	192 530	0,07	390 000 EUR	Bank of America Corp, 1.662%, 25/04/28	368 569	0,13
300 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.200%, 25/08/26	294 315	0,11	370 000 EUR	Bank of America Corp, 3.648%, 31/03/29	372 494	0,13
300 000 EUR	Vodafone Group PLC, 0.900%, 24/11/26	284 418	0,10	200 000 EUR	Bank of America Corp, 1.381%, 09/05/30	178 820	0,06
200 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.875%, 20/11/29	186 684	0,07	110 000 EUR	Bank of America Corp, 0.694%, 22/03/31	91 919	0,03
300 000 EUR	Vodafone Group PLC, 1.600%, 29/07/31	268 800	0,10	430 000 EUR	Bank of America Corp, 0.694%, 22/03/31	359 321	0,13
100 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.500%, 24/05/39	87 247	0,03	200 000 EUR	Bank of America Corp, 0.654%, 26/10/31	163 808	0,06
340 000 EUR	Westpac Securities NZ Ltd, 0.427%, 14/12/26	312 494	0,11	100 000 EUR	Bank of America Corp, 1.102%, 24/05/32	83 330	0,03
Royaume-Uni – Total		18 095 367	6,54	200 000 EUR	Bank of America Corp, 2.824%, 27/04/33	187 652	0,07
États-Unis				470 000 EUR	Bank of America Corp, 1.776%, perpetual	451 543	0,16
100 000 EUR	AbbVie Inc, 0.750%, 18/11/27	92 260	0,03	100 000 EUR	Baxter International Inc, 1.300%, 30/05/25	96 630	0,03
100 000 EUR	AbbVie Inc, 2.625%, 15/11/28	98 341	0,04	150 000 EUR	Baxter International Inc, 1.300%, 15/05/29	134 634	0,05
150 000 EUR	AbbVie Inc, 2.125%, 01/06/29	143 303	0,05	100 000 EUR	Becton Dickinson & Co, 0.034%, 13/08/25	94 697	0,03
100 000 EUR	American Honda Finance Corp, 3.750%, 25/10/27	102 581	0,04	100 000 EUR	BlackRock Inc, 1.250%, 06/05/25	97 543	0,04
145 000 EUR	American Honda Finance Corp, 0.300%, 07/07/28	128 369	0,05	460 000 EUR	Booking Holdings Inc, 0.100%, 08/03/25	442 060	0,16
100 000 EUR	American Tower Corp, 4.125%, 16/05/27	102 180	0,04	120 000 EUR	Booking Holdings Inc, 1.800%, 03/03/27	115 526	0,04
300 000 EUR	American Tower Corp, 0.875%, 21/05/29	261 519	0,09	200 000 EUR	Booking Holdings Inc, 0.500%, 08/03/28	181 340	0,07
350 000 EUR	American Tower Corp, 1.250%, 21/05/33	281 767	0,10	110 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.250%, 15/05/29	116 409	0,04
150 000 EUR	Amgen Inc, 2.000%, 25/02/26	146 493	0,05	100 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.500%, 15/11/31	108 853	0,04
100 000 EUR	Apple Inc, 0.875%, 24/05/25	96 892	0,04	100 000 EUR	Booking Holdings Inc, 4.750%, 15/11/34	112 755	0,04
250 000 EUR	Apple Inc, 0.010%, 15/11/25	237 035	0,09	270 000 EUR	BorgWarner Inc, 1.000%, 19/05/31	222 188	0,08
200 000 EUR	Apple Inc, 1.625%, 10/11/26	194 256	0,07	150 000 EUR	Boston Scientific Corp, 0.625%, 01/12/27	137 073	0,05
200 000 EUR	Apple Inc, 2.000%, 17/09/27	195 688	0,07	200 000 EUR	Bristol-Myers Squibb Co, 1.000%, 15/05/25	194 100	0,07
200 000 EUR	Apple Inc, 1.375%, 24/05/29	187 912	0,07	110 000 EUR	Capital One Financial Corp, 1.650%, 12/06/29	96 824	0,03
350 000 EUR	Apple Inc, 0.500%, 15/11/31	298 189	0,11	200 000 EUR	Carrier Global Corp, 4.375%, 29/05/25	201 734	0,07
100 000 EUR	AT&T Inc, 3.500%, 17/12/25	100 227	0,04	100 000 EUR	Carrier Global Corp, 4.500%, 29/11/32	106 990	0,04
100 000 EUR	AT&T Inc, 0.250%, 04/03/26	93 877	0,03	170 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 0.300%, 15/12/24	164 577	0,06
200 000 EUR	AT&T Inc, 1.800%, 05/09/26	193 068	0,07	140 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 1.550%, 15/03/28	132 105	0,05
150 000 EUR	AT&T Inc, 1.600%, 19/05/28	140 792	0,05	180 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 1.400%, 15/06/31	158 530	0,06
200 000 EUR	AT&T Inc, 2.350%, 05/09/29	191 662	0,07				
100 000 EUR	AT&T Inc, 2.600%, 17/12/29	96 412	0,03				
200 000 EUR	AT&T Inc, 0.800%, 04/03/30	173 838	0,06				
300 000 EUR	AT&T Inc, 3.550%, 17/12/32	300 867	0,11				
200 000 EUR	AT&T Inc, 3.375%, 15/03/34	195 768	0,07				
200 000 EUR	AT&T Inc, 2.450%, 15/03/35	177 836	0,06				
150 000 EUR	AT&T Inc, 3.150%, 04/09/36	139 703	0,05				
100 000 EUR	AT&T Inc, 2.600%, 19/05/38	85 786	0,03				
100 000 EUR	AT&T Inc, 3.550%, perpetual	100 546	0,04				
200 000 EUR	AT&T Inc, 4.300%, perpetual	211 326	0,08				
100 000 EUR	Athene Global Funding, 0.366%, 10/09/26	91 542	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
250 000 EUR	Chubb INA Holdings Inc, 2.500%, 15/03/38	219 182	0,08	100 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 1.000%, 03/12/28	90 232	0,03
350 000 EUR	Citigroup Inc, 1.250%, 06/07/26	337 011	0,12	200 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 2.000%, 21/05/30	185 496	0,07
340 000 EUR	Citigroup Inc, 2.125%, 10/09/26	327 345	0,12	100 000 EUR	Fiserv Inc, 1.625%, 01/07/30	90 392	0,03
350 000 EUR	Citigroup Inc, 0.500%, 08/10/27	323 435	0,12	170 000 EUR	Fiserv Inc, 4.500%, perpetual	180 392	0,07
360 000 EUR	Citigroup Inc, 1.500%, 26/10/28	331 524	0,12	100 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 1.355%, 07/02/25	96 807	0,03
100 000 EUR	Citigroup Inc, 1.250%, 10/04/29	89 906	0,03	100 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 3.250%, 15/09/25	98 754	0,04
100 000 EUR	Citigroup Inc, 4.112%, 22/09/33	103 157	0,04	100 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 2.330%, 25/11/25	97 083	0,04
200 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.875%, 22/09/26	194 032	0,07	100 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 2.386%, 17/02/26	97 150	0,04
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.125%, 09/03/27	94 352	0,03	100 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 4.867%, 03/08/27	102 815	0,04
200 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.125%, 09/03/29	174 224	0,06	100 000 EUR	Ford Motor Credit Co LLC, 5.125%, 20/02/29	104 698	0,04
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.125%, 15/03/29	87 197	0,03	200 000 EUR	General Electric Co, 1.500%, 17/05/29	185 148	0,07
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.400%, 06/05/30	85 837	0,03	150 000 EUR	General Electric Co, 4.125%, 19/09/35	160 498	0,06
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.250%, 08/03/31	89 595	0,03	100 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 0.600%, 20/05/27	91 386	0,03
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.500%, 09/03/33	80 433	0,03	100 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 4.300%, 15/02/29	103 025	0,04
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.375%, 15/03/33	79 578	0,03	200 000 EUR	General Motors Financial Co Inc, 4.500%, perpetual	207 262	0,07
150 000 EUR	Coca-Cola Co, 1.625%, 09/03/35	129 621	0,05	200 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 3.375%, 27/03/25	199 592	0,07
100 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.950%, 06/05/36	77 854	0,03	110 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.250%, 01/05/25	106 555	0,04
110 000 EUR	Coca-Cola Co, 0.800%, 15/03/40	76 616	0,03	250 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.625%, 27/07/26	240 312	0,09
100 000 EUR	Colgate-Palmolive Co, 0.300%, 10/11/29	87 422	0,03	200 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.250%, 26/01/28	177 110	0,06
110 000 EUR	Colgate-Palmolive Co, 1.375%, 06/03/34	96 217	0,03	220 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 2.000%, 22/03/28	209 955	0,08
100 000 EUR	Colgate-Palmolive Co, 0.875%, 12/11/39	71 557	0,03	140 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 2.000%, 01/11/28	132 356	0,05
100 000 EUR	Comcast Corp, 0.010%, 14/09/26	92 235	0,03	580 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.250%, 07/02/29	518 967	0,19
200 000 EUR	Comcast Corp, 0.250%, 20/05/27	183 354	0,07	100 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 0.875%, 21/01/30	86 048	0,03
100 000 EUR	Comcast Corp, 0.250%, 14/09/29	86 456	0,03	430 000 EUR	Goldman Sachs Group Inc, 1.000%, 18/03/33	341 566	0,12
100 000 EUR	Comcast Corp, 0.750%, 20/02/32	84 086	0,03	100 000 EUR	Illinois Tool Works Inc, 0.250%, 05/12/24	96 894	0,04
100 000 EUR	Comcast Corp, 1.250%, 20/02/40	75 648	0,03	130 000 EUR	Illinois Tool Works Inc, 1.000%, 05/06/31	114 410	0,04
100 000 EUR	Danaher Corp, 2.100%, 30/09/26	97 770	0,04	290 000 EUR	Illinois Tool Works Inc, 3.000%, 19/05/34	287 979	0,10
100 000 EUR	Danaher Corp, 2.500%, 30/03/30	97 022	0,04	100 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.875%, 31/01/25	97 111	0,04
370 000 EUR	Digital Euro Finco LLC, 2.500%, 16/01/26	360 247	0,13	300 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.950%, 23/05/25	290 067	0,10
100 000 EUR	Discovery Communications LLC, 1.900%, 19/03/27	95 164	0,03				
100 000 EUR	Dover Corp, 1.250%, 09/11/26	95 261	0,03				
200 000 EUR	Dover Corp, 0.750%, 04/11/27	183 076	0,07				
170 000 EUR	Ecolab Inc, 2.625%, 08/07/25	168 070	0,06				
100 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.625%, 02/06/26	97 160	0,04				
100 000 EUR	Eli Lilly & Co, 2.125%, 03/06/30	96 979	0,04				
100 000 EUR	Eli Lilly & Co, 0.500%, 14/09/33	81 434	0,03				
300 000 EUR	Eli Lilly & Co, 1.700%, 01/11/49	226 530	0,08				
150 000 EUR	Emerson Electric Co, 2.000%, 15/10/29	142 580	0,05				
200 000 EUR	Equinix Inc, 0.250%, 15/03/27	182 110	0,07				
160 000 EUR	Equinix Inc, 1.000%, 15/03/33	129 374	0,05				
100 000 EUR	Euronet Worldwide Inc, 1.375%, 22/05/26	93 711	0,03				
200 000 EUR	FedEx Corp, 1.625%, 11/01/27	191 588	0,07				
100 000 EUR	FedEx Corp, 0.950%, 04/05/33	78 922	0,03				
160 000 EUR	Fidelity National Information Services Inc, 1.500%, 21/05/27	151 432	0,05				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
300 000 EUR	International Business Machines Corp, 2.875%, 07/11/25	298 179	0,11	100 000 EUR	McDonald's Corp, 1.500%, 28/11/29	91 450	0,03
200 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.250%, 29/01/27	190 010	0,07	300 000 EUR	McDonald's Corp, 1.600%, 15/03/31	269 733	0,10
160 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.300%, 11/02/28	144 138	0,05	300 000 EUR	McDonald's Corp, 3.000%, 31/05/34	291 033	0,11
200 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.500%, 23/05/29	186 212	0,07	200 000 EUR	McDonald's Corp, 4.250%, 07/03/35	214 852	0,08
200 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.750%, 31/01/31	183 498	0,07	200 000 EUR	McDonald's Corp, 4.125%, 28/11/35	210 784	0,08
180 000 EUR	International Business Machines Corp, 0.650%, 11/02/32	148 822	0,05	100 000 EUR	McKesson Corp, 1.500%, 17/11/25	96 872	0,03
100 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.250%, 09/02/34	83 642	0,03	100 000 EUR	Merck & Co Inc, 1.875%, 15/10/26	97 299	0,04
350 000 EUR	International Business Machines Corp, 1.200%, 11/02/40	254 222	0,09	100 000 EUR	Merck & Co Inc, 2.500%, 15/10/34	96 826	0,03
100 000 EUR	Johnson & Johnson, 1.150%, 20/11/28	94 101	0,03	100 000 EUR	Merck & Co Inc, 1.375%, 02/11/36	82 883	0,03
200 000 EUR	Johnson & Johnson, 1.650%, 20/05/35	179 498	0,06	150 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.550%, 16/06/27	137 715	0,05
200 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.500%, 27/01/25	195 086	0,07	100 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 0.500%, 25/05/29	87 004	0,03
150 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 3.000%, 19/02/26	148 964	0,05	100 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 3.750%, 05/12/30	102 643	0,04
320 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.500%, 29/10/26	306 602	0,11	100 000 EUR	Metropolitan Life Global Funding I, 3.750%, 07/12/31	102 945	0,04
400 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.090%, 11/03/27	380 008	0,14	320 000 EUR	Microsoft Corp, 2.625%, 02/05/33	322 979	0,12
600 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.638%, 18/05/28	566 766	0,20	300 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 0.625%, 13/06/25	287 454	0,10
330 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.963%, 23/03/30	307 382	0,11	100 000 EUR	MMS USA Holdings Inc, 1.750%, 13/06/31	90 496	0,03
250 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.001%, 25/07/31	213 315	0,08	200 000 EUR	Mondelez International Inc, 0.250%, 17/03/28	178 834	0,06
200 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 1.047%, 04/11/32	167 370	0,06	100 000 EUR	Mondelez International Inc, 0.750%, 17/03/33	80 784	0,03
100 000 EUR	JPMorgan Chase & Co, 0.597%, 17/02/33	80 412	0,03	160 000 EUR	Mondelez International Inc, 1.375%, 17/03/41	117 240	0,04
100 000 EUR	KKR Group Finance Co V LLC, 1.625%, 22/05/29	90 090	0,03	100 000 EUR	Moody's Corp, 1.750%, 09/03/27	96 346	0,03
100 000 EUR	Marsh & McLennan Cos Inc, 1.349%, 21/09/26	95 752	0,03	100 000 EUR	Moody's Corp, 0.950%, 25/02/30	88 774	0,03
270 000 EUR	Marsh & McLennan Cos Inc, 1.979%, 21/03/30	254 413	0,09	380 000 EUR	Morgan Stanley, 2.103%, 08/05/26	371 366	0,13
100 000 EUR	Mastercard Inc, 2.100%, 01/12/27	97 327	0,04	360 000 EUR	Morgan Stanley, 1.342%, 23/10/26	345 503	0,12
300 000 EUR	McDonald's Corp, 0.900%, 15/06/26	285 384	0,10	270 000 EUR	Morgan Stanley, 1.875%, 27/04/27	257 626	0,09
100 000 EUR	McDonald's Corp, 1.875%, 26/05/27	96 120	0,03	190 000 EUR	Morgan Stanley, 4.813%, 25/10/28	198 843	0,07
150 000 EUR	McDonald's Corp, 3.625%, 28/11/27	153 197	0,06	300 000 EUR	Morgan Stanley, 4.656%, 02/03/29	311 478	0,11
100 000 EUR	McDonald's Corp, 1.750%, 03/05/28	94 934	0,03	370 000 EUR	Morgan Stanley, 0.495%, 26/10/29	319 428	0,12
500 000 EUR	McDonald's Corp, 2.375%, 31/05/29	484 765	0,18	200 000 EUR	Morgan Stanley, 0.497%, 07/02/31	165 636	0,06
400 000 EUR	McDonald's Corp, 2.625%, 11/06/29	392 408	0,14	460 000 EUR	Morgan Stanley, 1.102%, 29/04/33	373 414	0,13
				100 000 EUR	Nasdaq Inc, 0.875%, 13/02/30	86 807	0,03
				100 000 EUR	Nasdaq Inc, 4.500%, 15/02/32	107 048	0,04
				320 000 EUR	Netflix Inc, 3.000%, 15/06/25	318 282	0,12
				200 000 EUR	Netflix Inc, 3.875%, 15/11/29	206 614	0,07
				230 000 EUR	Netflix Inc, 3.625%, 15/06/30	234 391	0,08
				100 000 EUR	Oracle Corp, 3.125%, 10/07/25	99 796	0,04
				100 000 EUR	Parker-Hannifin Corp, 1.125%, 01/03/25	96 973	0,04
				150 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.500%, 06/05/28	136 499	0,05
				100 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.875%, 18/07/28	91 992	0,03
				100 000 EUR	PepsiCo Inc, 1.125%, 18/03/31	89 114	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)				Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
200 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.400%, 09/10/32	161 614	0,06	200 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 3.850%, 24/07/30	207 812	0,08
100 000 EUR	PepsiCo Inc, 0.875%, 16/10/39	72 484	0,03	100 000 EUR	Unilever Capital Corp, 3.300%, 06/06/29	102 271	0,04
100 000 EUR	Pfizer Inc, 1.000%, 06/03/27	94 712	0,03	100 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.625%, 15/11/25	97 343	0,04
190 000 EUR	PPG Industries Inc, 0.875%, 03/11/25	181 554	0,07	100 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.000%, 15/11/28	92 093	0,03
200 000 EUR	PPG Industries Inc, 1.400%, 13/03/27	188 620	0,07	100 000 EUR	United Parcel Service Inc, 1.500%, 15/11/32	87 804	0,03
130 000 EUR	Procter & Gamble Co, 4.875%, 11/05/27	138 454	0,05	130 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.875%, 02/04/25	125 925	0,05
100 000 EUR	Procter & Gamble Co, 1.200%, 30/10/28	93 371	0,03	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 3.250%, 17/02/26	100 336	0,04
200 000 EUR	Procter & Gamble Co, 0.350%, 05/05/30	172 266	0,06	200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.375%, 27/10/26	191 348	0,07
300 000 EUR	Procter & Gamble Co, 0.900%, 04/11/41	211 536	0,08	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.875%, 08/04/27	93 468	0,03
150 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 0.375%, 06/02/28	133 727	0,05	150 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.375%, 22/03/29	130 395	0,05
200 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.875%, 05/01/29	186 042	0,07	200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.875%, 26/10/29	186 594	0,07
300 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.500%, 08/02/34	244 731	0,09	150 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.250%, 08/04/30	133 613	0,05
310 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 1.000%, 06/02/35	231 089	0,08	200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 2.625%, 01/12/31	191 054	0,07
300 000 EUR	Prologis Euro Finance LLC, 4.625%, perpetual	320 124	0,12	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.875%, 19/03/32	82 719	0,03
100 000 EUR	PVH Corp, 3.125%, 15/12/27	97 927	0,04	200 000 EUR	Verizon Communications Inc, 0.750%, 22/03/32	164 014	0,06
100 000 EUR	RELX Capital Inc, 1.300%, 12/05/25	97 164	0,04	250 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.300%, 18/05/33	208 682	0,08
230 000 EUR	Revvity Inc, 1.875%, 19/07/26	221 570	0,08	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 4.750%, 31/10/34	110 772	0,04
130 000 EUR	Southern Power Co, 1.850%, 20/06/26	125 701	0,05	150 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.125%, 19/09/35	115 911	0,04
200 000 EUR	Stryker Corp, 0.750%, 01/03/29	177 844	0,06	225 000 EUR	Verizon Communications Inc, 2.875%, 15/01/38	207 769	0,08
350 000 EUR	Stryker Corp, 2.625%, 30/11/30	338 772	0,12	100 000 EUR	Verizon Communications Inc, 1.850%, 18/05/40	78 391	0,03
200 000 EUR	Tapestry Inc, 5.375%, 27/11/27	207 174	0,07	100 000 EUR	VF Corp, 0.250%, 25/02/28	84 046	0,03
200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 0.125%, 01/03/25	192 326	0,07	100 000 EUR	VF Corp, 0.625%, 25/02/32	70 088	0,03
200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.400%, 23/01/26	192 984	0,07	360 000 EUR	Visa Inc, 1.500%, 15/06/26	347 861	0,13
100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.750%, 15/04/27	96 448	0,03	120 000 EUR	Visa Inc, 2.375%, 15/06/34	114 640	0,04
200 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 0.500%, 01/03/28	181 814	0,07	100 000 EUR	Walgreens Boots Alliance Inc, 2.125%, 20/11/26	93 098	0,03
100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.950%, 24/07/29	94 900	0,03	310 000 EUR	Worley US Finance Sub Ltd, 0.875%, 09/06/26	289 531	0,10
100 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 0.875%, 01/10/31	85 292	0,03				
150 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 2.375%, 15/04/32	142 215	0,05				
210 000 EUR	Thermo Fisher Scientific Inc, 1.875%, 01/10/49	150 131	0,05				
100 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 0.250%, 16/07/26	93 310	0,03				
280 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 0.125%, 05/11/27	251 252	0,09				
100 000 EUR	Toyota Motor Credit Corp, 4.050%, 13/09/29	104 915	0,04				

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en euros)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 98,65 % (suite)			
États-Unis (suite)			
100 000 EUR	Zimmer Biomet Holdings Inc, 2.425%, 13/12/26	98 081	0,04
100 000 EUR	Zimmer Biomet Holdings Inc, 1.164%, 15/11/27	92 675	0,03
États-Unis – Total		43 835 412	15,84
Total des obligations d'entreprise		273 008 540	98,65
Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
		273 008 540	98,65
TOTAL DES INVESTISSEMENTS		273 008 540	98,65
Autres actifs/(passifs) nets		3 729 769	1,35
TOTAL DES ACTIFS NETS		276 738 309	100,00

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>				
Obligations d'entreprise – 96,48 %				Obligations d'entreprise – 96,48 % <i>(suite)</i>				
Argentine				Australie <i>(suite)</i>				
75 600 USD	Generacion Mediterranea SA / Central Termica Roca SA, 9.875%, 01/12/27	66 226	0,01	75 000 USD	Perenti Finance Pty Ltd, 6.500%, 07/10/25	73 425	0,01	
56 000 USD	Genneia SA, 8.750%, 02/09/27	55 420	0,01	100 000 USD	Port of Newcastle Investments Financing Pty Ltd, 5.900%, 24/11/31	90 428	0,02	
150 000 USD	MSU Energy SA / UGEN SA / UENSA SA, 6.875%, 01/02/25	114 372	0,02	Australie – Total			2 529 662	0,48
50 000 USD	Pampa Energia SA, 9.500%, 08/12/26	52 775	0,01	Autriche				
250 000 USD	Pampa Energia SA, 7.500%, 24/01/27	244 035	0,05	350 000 EUR	ams-OSRAM AG, 10.500%, 30/03/29	419 394	0,08	
150 000 USD	Pampa Energia SA, 9.125%, 15/04/29	146 701	0,03	100 000 USD	ams-OSRAM AG, 12.250%, 30/03/29	111 208	0,02	
45 000 USD	Pan American Energy LLC/Argentina, 9.125%, 30/04/27	48 328	0,01	200 000 EUR	Benteler International AG, 9.375%, 15/05/28	235 620	0,04	
67 000 USD	Telecom Argentina SA, 8.500%, 06/08/25	65 263	0,01	200 000 USD	Benteler International AG, 10.500%, 15/05/28	210 686	0,04	
100 000 USD	Telecom Argentina SA, 8.000%, 18/07/26	94 905	0,02	100 000 USD	BRF GmbH, 4.350%, 29/09/26	94 180	0,02	
200 000 USD	Transportadora de Gas del Sur SA, 6.750%, 02/05/25	191 299	0,04	100 000 USD	lochpe-Maxion Austria GmbH / Maxion Wheels de Mexico S de RL de CV, 5.000%, perpetual	89 440	0,02	
125 000 USD	YPF Energia Electrica SA, 10.000%, 25/07/26	120 988	0,02	100 000 USD	Klabin Austria GmbH, 5.750%, 03/04/29	101 339	0,02	
93 750 USD	YPF SA, 8.500%, 23/03/25	91 172	0,02	200 000 USD	Klabin Austria GmbH, 3.200%, 12/01/31	167 495	0,03	
350 000 USD	YPF SA, 8.500%, 28/07/25	337 954	0,06	320 000 USD	Klabin Austria GmbH, 7.000%, 03/04/49	323 379	0,06	
155 769 USD	YPF SA, 9.000%, 12/02/26	158 355	0,03	100 000 EUR	Sappi Papier Holding GmbH, 3.625%, 15/03/28	105 664	0,02	
180 000 USD	YPF SA, 6.950%, 21/07/27	161 058	0,03	Autriche – Total			1 858 405	0,35
150 000 USD	YPF SA, 8.500%, 27/06/29	138 755	0,03	Azerbaïdjan				
250 000 USD	YPF SA, 9.000%, 30/06/29	240 866	0,05	200 000 USD	State Oil Co of the Azerbaijan Republic, 6.950%, 18/03/30	209 750	0,04	
300 000 USD	YPF SA, 7.000%, 30/09/33	241 989	0,05	Azerbaïdjan – Total			209 750	0,04
110 000 USD	YPF SA, 7.000%, 15/12/47	83 094	0,01	Belgique				
Argentine – Total			2 653 555	0,51	200 000 EUR	Azelis Finance NV, 5.750%, 15/03/28	228 132	0,04
Australie				100 000 EUR	Elia Group SA/NV, 5.850%, perpetual	112 260	0,02	
200 000 EUR	APA Infrastructure Ltd, 7.125%, 09/11/83	231 976	0,04	100 000 EUR	Ideal Standard International SA, 6.375%, 30/07/26	86 052	0,02	
99 000 USD	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 4.500%, 15/09/27	95 132	0,02	100 000 EUR	Manuchar Group Sarl, 7.250%, 30/06/27	102 567	0,02	
250 000 USD	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 5.875%, 15/04/30	248 667	0,05	200 000 EUR	Ontex Group NV, 3.500%, 15/07/26	212 314	0,04	
394 000 USD	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 4.375%, 01/04/31	360 707	0,07	100 000 EUR	Sarens Finance Co NV, 5.750%, 21/02/27	101 166	0,02	
188 000 USD	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 6.125%, 15/04/32	189 439	0,03	Belgique – Total			842 491	0,16
104 000 USD	Infrabuild Australia Pty Ltd, 14.500%, 15/11/28	107 120	0,02	Bermudes				
172 000 USD	Mineral Resources Ltd, 8.125%, 01/05/27	175 013	0,03	150 000 USD	Geopark Ltd, 5.500%, 17/01/27	133 052	0,03	
185 000 USD	Mineral Resources Ltd, 8.000%, 01/11/27	189 678	0,04	225 000 USD	Investment Energy Resources Ltd, 6.250%, 26/04/29	212 551	0,04	
346 291 USD	Mineral Resources Ltd, 9.250%, 01/10/28	368 374	0,07	200 000 USD	Lancashire Holdings Ltd, 5.625%, 18/09/41	170 750	0,03	
250 000 USD	Mineral Resources Ltd, 8.500%, 01/05/30	260 582	0,05	142 000 USD	Nabors Industries Ltd, 7.250%, 15/01/26	136 492	0,03	
150 000 USD	Nufarm Australia Ltd / Nufarm Americas Inc, 5.000%, 27/01/30	139 121	0,03	225 000 USD	Nabors Industries Ltd, 7.500%, 15/01/28	195 469	0,04	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				
Bermudes (suite)				Brésil (suite)				
67 000 USD	NCL Corp Ltd, 3.625%, 15/12/24	65 155	0,01	200 000 USD	Natura Cosméticos SA, 4.125%, 03/05/28	180 837	0,03	
462 000 USD	NCL Corp Ltd, 5.875%, 15/03/26	451 042	0,09	100 000 USD	Nexa Resources SA, 6.500%, perpetual	101 060	0,02	
150 000 USD	NCL Corp Ltd, 8.375%, 01/02/28	158 951	0,03	200 000 USD	StoneCo Ltd, 3.950%, 16/06/28	172 416	0,03	
175 000 USD	NCL Corp Ltd, 8.125%, 15/01/29	182 722	0,03	Brésil – Total			3 395 383	
113 000 USD	NCL Finance Ltd, 6.125%, 15/03/28	107 928	0,02	Îles Vierges britanniques				
189 744 USD	Odfjell Rig III Ltd, 9.250%, 31/05/28	194 013	0,04	100 000 USD	Arcos Dorados Holdings Inc, 5.875%, 04/04/27	98 642	0,02	
75 000 USD	Sagcor Financial Co Ltd, 5.300%, 13/05/28	72 000	0,01	100 000 USD	CAS Capital No 1 Ltd, 4.000%, perpetual	86 240	0,02	
200 000 USD	Seadrill Finance Ltd, 8.375%, 01/08/30	208 666	0,04	380 000 USD	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 5.250%, 27/04/29	357 162	0,07	
334 000 USD	Valaris Ltd, 8.375%, 30/04/30	342 196	0,06	200 000 USD	Champion Path Holdings Ltd, 4.500%, 27/01/26	185 977	0,04	
186 000 USD	Viking Cruises Ltd, 5.875%, 15/09/27	179 490	0,03	200 000 USD	ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.375%, 12/05/26	187 551	0,04	
109 000 USD	Viking Cruises Ltd, 7.000%, 15/02/29	108 063	0,02	200 000 USD	Fortune Star BVI Ltd, 5.950%, 19/10/25	164 987	0,03	
100 000 USD	Viking Cruises Ltd, 9.125%, 15/07/31	106 571	0,02	100 000 EUR	Fortune Star BVI Ltd, 3.950%, 02/10/26	66 434	0,01	
245 000 USD	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 5.625%, 15/02/29	238 875	0,05	200 000 USD	Fortune Star BVI Ltd, 5.050%, 27/01/27	131 537	0,02	
121 000 USD	VOC Escrow Ltd, 5.000%, 15/02/28	116 064	0,02	200 000 USD	Franshion Brilliant Ltd, 6.000%, perpetual	168 333	0,03	
387 000 USD	Weatherford International Ltd, 8.625%, 30/04/30	403 978	0,08	200 000 USD	New Metro Global Ltd, 4.800%, 15/12/24	78 000	0,01	
Bermudes – Total			3 784 028	0,72	200 000 USD	New Metro Global Ltd, 4.625%, 15/10/25	56 000	0,01
Brésil				200 000 USD	RKPF Overseas 2019 A Ltd, 6.000%, 04/09/25	87 616	0,02	
100 000 USD	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao, 4.125%, 20/09/31	87 406	0,02	200 000 USD	RKPF Overseas 2020 A Ltd, 5.200%, 12/01/26	50 648	0,01	
150 000 USD	Banco Bradesco SA s, 3.200%, 27/01/25	145 724	0,03	200 000 USD	RKPF Overseas 2020 A Ltd, 5.125%, 26/07/26	45 940	0,01	
85 000 USD	Banco Bradesco SA s, 4.375%, 18/03/27	82 615	0,02	162 160 USD	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd, 6.750%, 24/04/33	161 638	0,03	
200 000 USD	Banco BTG Pactual SA s, 4.500%, 10/01/25	196 505	0,04	250 000 USD	Studio City Co Ltd, 7.000%, 15/02/27	245 950	0,05	
150 000 USD	Banco do Brasil SA, 4.625%, 15/01/25	147 914	0,03	135 000 USD	Studio City Finance Ltd, 6.000%, 15/07/25	132 300	0,02	
200 000 USD	Banco do Brasil SA, 4.875%, 11/01/29	195 991	0,04	225 000 USD	Studio City Finance Ltd, 6.500%, 15/01/28	207 844	0,04	
400 000 USD	Banco do Brasil SA, 6.250%, 18/04/30	416 240	0,08	230 000 USD	Studio City Finance Ltd, 5.000%, 15/01/29	193 200	0,04	
200 000 USD	Banco Votorantim SA, 4.375%, 29/07/25	195 218	0,04	250 000 USD	Wanda Properties Global Co Ltd, 11.000%, 20/01/25	175 000	0,03	
300 000 USD	BRF SA, 5.750%, 21/09/50	224 023	0,04	Îles Vierges britanniques – Total			2 880 999	
200 000 USD	Cemig Geracao e Transmissao SA, 9.250%, 05/12/24	200 420	0,04	Bulgarie				
225 000 USD	Centrais Eletricas Brasileiras SA, 3.625%, 04/02/25	217 570	0,04	150 000 EUR	Bulgarian Energy Holding EAD, 3.500%, 28/06/25	160 620	0,03	
200 000 USD	Centrais Eletricas Brasileiras SA, 4.625%, 04/02/30	182 082	0,03	100 000 EUR	Bulgarian Energy Holding EAD, 2.450%, 22/07/28	95 250	0,02	
200 000 USD	Cosan Luxembourg SA, 5.500%, 20/09/29	190 382	0,04	Bulgarie – Total			255 870	
350 000 USD	Csn Resources SA, 4.625%, perpetual	286 339	0,05					
200 000 USD	Globo Comunicacao e Participacoes SA, 4.875%, 22/01/30	172 641	0,03					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Canada				Canada (suite)			
73 000 USD	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 5.750%, 15/04/25	72 759	0,01	386 000 USD	Bombardier Inc, 7.125%, 15/06/26	384 249	0,07
385 000 USD	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 3.875%, 15/01/28	363 621	0,07	434 000 USD	Bombardier Inc, 7.875%, 15/04/27	434 096	0,08
207 000 USD	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 4.375%, 15/01/28	197 848	0,04	136 000 USD	Bombardier Inc, 6.000%, 15/02/28	132 477	0,03
100 000 USD	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 3.500%, 15/02/29	91 802	0,02	270 000 USD	Bombardier Inc, 7.500%, 01/02/29	274 329	0,05
756 000 USD	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 4.000%, 15/10/30	677 823	0,13	366 000 USD	Bombardier Inc, 8.750%, 15/11/30	389 774	0,07
315 000 USD	Air Canada, 3.875%, 15/08/26	300 914	0,06	70 000 USD	Bombardier Inc, 7.450%, 01/05/34	79 800	0,02
410 000 CAD	Air Canada, 4.625%, 15/08/29	287 033	0,05	100 000 CAD	Brookfield Property Finance ULC, 3.926%, 24/08/25	71 693	0,01
200 000 USD	Algonquin Power & Utilities Corp, 4.750%, 18/01/82	169 000	0,03	120 000 CAD	Brookfield Property Finance ULC, 4.000%, 30/09/26	83 290	0,02
100 000 CAD	Algonquin Power & Utilities Corp, 5.250%, 18/01/82	62 957	0,01	50 000 CAD	Brookfield Property Finance ULC, 3.930%, 15/01/27	34 163	0,01
50 000 CAD	AltaGas Ltd, 5.250%, 11/01/82	31 729	0,01	200 000 CAD	Brookfield Property Finance ULC, 7.125%, 13/02/28	149 088	0,03
50 000 CAD	AltaGas Ltd, 7.350%, 17/08/82	37 590	0,01	147 000 USD	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC, 6.250%, 15/09/27	142 426	0,03
100 000 CAD	AltaGas Ltd, 8.900%, 10/11/83	79 263	0,02	60 000 USD	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC, 5.000%, 15/06/29	53 259	0,01
100 000 USD	Aris Mining Corp, 6.875%, 09/08/26	86 500	0,02	1 095 000 USD	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC, 4.875%, 15/02/30	962 972	0,18
60 000 USD	ATS Corp, 4.125%, 15/12/28	55 184	0,01	300 000 USD	Canacol Energy Ltd, 5.750%, 24/11/28	218 755	0,04
120 000 USD	Baffinland Iron Mines Corp / Baffinland Iron Mines LP, 8.750%, 15/07/26	112 313	0,02	74 000 USD	Clarios Global LP, 6.750%, 15/05/25	74 651	0,01
385 000 USD	Bausch & Lomb Escrow Corp, 8.375%, 01/10/28	406 152	0,08	49 000 USD	Conuma Resources Ltd, 13.125%, 01/05/28	47 146	0,01
390 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 5.500%, 01/11/25	356 760	0,07	80 000 CAD	Corus Entertainment Inc, 5.000%, 11/05/28	40 043	0,01
250 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 9.000%, 15/12/25	233 598	0,04	100 000 CAD	Doman Building Materials Group Ltd, 5.250%, 15/05/26	69 724	0,01
255 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 6.125%, 01/02/27	172 125	0,03	180 000 USD	Eldorado Gold Corp, 6.250%, 01/09/29	169 771	0,03
100 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 5.750%, 15/08/27	64 500	0,01	450 000 USD	Emera Inc, 6.750%, 15/06/76	440 620	0,08
100 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 5.000%, 30/01/28	45 491	0,01	170 000 USD	Empire Communities Corp, 7.000%, 15/12/25	167 827	0,03
402 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 4.875%, 01/06/28	242 261	0,05	249 000 USD	Enerflex Ltd, 9.000%, 15/10/27	241 996	0,05
469 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 11.000%, 30/09/28	340 954	0,07	100 000 USD	ERO Copper Corp, 6.500%, 15/02/30	88 256	0,02
250 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 5.000%, 15/02/29	108 604	0,02	310 000 USD	First Quantum Minerals Ltd, 7.500%, 01/04/25	296 179	0,06
148 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 6.250%, 15/02/29	65 507	0,01	250 000 USD	First Quantum Minerals Ltd, 6.875%, 01/03/26	224 733	0,04
30 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 7.250%, 30/05/29	13 678	0,00	490 000 USD	First Quantum Minerals Ltd, 6.875%, 15/10/27	416 424	0,08
223 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 5.250%, 30/01/30	102 796	0,02	350 000 USD	First Quantum Minerals Ltd, 8.625%, 01/06/31	296 758	0,06
168 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 14.000%, 15/10/30	92 272	0,02	100 000 USD	Frontera Energy Corp, 7.875%, 21/06/28	74 793	0,01
110 000 USD	Bausch Health Cos Inc, 5.250%, 15/02/31	47 412	0,01	83 000 USD	Garda World Security Corp, 4.625%, 15/02/27	79 908	0,02
106 000 USD	Baytex Energy Corp, 8.750%, 01/04/27	109 634	0,02	196 000 USD	Garda World Security Corp, 9.500%, 01/11/27	197 603	0,04
217 000 USD	Baytex Energy Corp, 8.500%, 30/04/30	224 518	0,04	140 000 USD	Garda World Security Corp, 7.750%, 15/02/28	144 845	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Canada (suite)				Canada (suite)			
62 000 USD	Garda World Security Corp, 6.000%, 01/06/29	55 607	0,01	50 000 USD	Mercer International Inc, 12.875%, 01/10/28	54 652	0,01
125 000 USD	Gfl Environmental Inc, 4.750%, 15/06/29	117 721	0,02	151 000 USD	Methanex Corp, 5.125%, 15/10/27	147 535	0,03
170 000 USD	GFL Environmental Inc, 4.250%, 01/06/25	167 490	0,03	203 000 USD	Methanex Corp, 5.250%, 15/12/29	195 316	0,04
144 000 USD	GFL Environmental Inc, 3.750%, 01/08/25	140 613	0,03	205 000 USD	Methanex Corp, 5.650%, 01/12/44	178 723	0,03
145 000 USD	GFL Environmental Inc, 5.125%, 15/12/26	143 460	0,03	200 000 CAD	National Bank of Canada, 7.500%, 16/11/82	150 676	0,03
205 000 USD	GFL Environmental Inc, 4.000%, 01/08/28	189 518	0,04	65 000 USD	New Gold Inc, 7.500%, 15/07/27	65 586	0,01
133 000 USD	GFL Environmental Inc, 3.500%, 01/09/28	122 909	0,02	129 000 USD	Northriver Midstream Finance LP, 5.625%, 15/02/26	125 088	0,02
124 000 USD	GFL Environmental Inc, 4.375%, 15/08/29	114 513	0,02	150 000 USD	NOVA Chemicals Corp, 5.000%, 01/05/25	146 402	0,03
260 000 USD	GFL Environmental Inc, 6.750%, 15/01/31	267 923	0,05	325 000 USD	NOVA Chemicals Corp, 5.250%, 01/06/27	304 690	0,06
90 000 CAD	Gibson Energy Inc, 5.250%, 22/12/80	58 318	0,01	75 000 USD	NOVA Chemicals Corp, 8.500%, 15/11/28	78 650	0,01
125 000 USD	goeasy Ltd, 4.375%, 01/05/26	120 349	0,02	94 000 USD	NOVA Chemicals Corp, 4.250%, 15/05/29	79 146	0,02
162 000 USD	goeasy Ltd, 9.250%, 01/12/28	173 011	0,03	56 000 USD	Ontario Gaming GTA LP, 8.000%, 01/08/30	57 750	0,01
200 000 USD	Greenfire Resources Ltd, 12.000%, 01/10/28	198 640	0,04	244 000 USD	Open Text Corp, 3.875%, 15/02/28	226 855	0,04
99 000 USD	Hudbay Minerals Inc, 4.500%, 01/04/26	95 785	0,02	248 000 USD	Open Text Corp, 3.875%, 01/12/29	222 355	0,04
162 000 USD	Hudbay Minerals Inc, 6.125%, 01/04/29	158 752	0,03	177 000 USD	Parkland Corp, 5.875%, 15/07/27	176 285	0,03
120 000 USD	Husky III Holding Ltd, 13.000%, 15/02/25	119 474	0,02	40 000 CAD	Parkland Corp, 4.375%, 26/03/29	27 757	0,01
120 000 USD	Iamgold Corp, 5.750%, 15/10/28	103 187	0,02	178 000 USD	Parkland Corp, 4.500%, 01/10/29	163 132	0,03
208 000 USD	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc / Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC, 6.000%, 15/09/28	193 767	0,04	180 000 USD	Parkland Corp, 4.625%, 01/05/30	165 600	0,03
250 000 CAD	Inter Pipeline Ltd/AB, 6.875%, 26/03/79	182 208	0,03	240 000 CAD	Parkland Corp, 3.875%, perpetual	174 048	0,03
100 000 USD	International Petroleum Corp, 7.250%, 01/02/27	92 800	0,02	100 000 CAD	Parkland Corp, 6.000%, perpetual	75 743	0,01
217 000 USD	Jones Deslauriers Insurance Management Inc, 8.500%, 15/03/30	227 878	0,04	210 000 CAD	Pembina Pipeline Corp, 4.800%, 25/01/81	134 282	0,03
100 000 USD	Jones Deslauriers Insurance Management Inc, 10.500%, 15/12/30	105 390	0,02	91 000 USD	Precision Drilling Corp, 7.125%, 15/01/26	90 582	0,02
180 000 CAD	Keyera Corp, 6.875%, 13/06/79	132 113	0,03	125 000 USD	Precision Drilling Corp, 6.875%, 15/01/29	120 541	0,02
110 000 CAD	Keyera Corp, 5.950%, 10/03/81	73 751	0,01	550 000 CAD	Rogers Communications Inc, 5.000%, 17/12/81	396 726	0,08
160 000 CAD	Laurentian Bank of Canada, 5.095%, 15/06/32	115 370	0,02	250 000 USD	Rogers Communications Inc, 5.250%, 15/03/82	239 903	0,05
172 000 USD	Masonite International Corp, 5.375%, 01/02/28	165 120	0,03	50 000 CAD	Russet Metals Inc, 5.750%, 27/10/25	37 824	0,01
70 000 USD	Masonite International Corp, 3.500%, 15/02/30	60 677	0,01	50 000 CAD	Secure Energy Services Inc, 7.250%, 30/12/26	38 085	0,01
175 000 USD	Mattamy Group Corp, 5.250%, 15/12/27	169 974	0,03	170 000 CAD	SNC-Lavalin Group Inc, 7.000%, 12/06/26	131 933	0,03
206 000 USD	Mattamy Group Corp, 4.625%, 01/03/30	190 915	0,04	279 000 USD	Strathcona Resources Ltd/Alberta, 6.875%, 01/08/26	266 443	0,05
				100 000 CAD	Superior Plus LP, 4.250%, 18/05/28	70 055	0,01
				196 000 USD	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 4.500%, 15/03/29	181 745	0,03
				155 000 USD	Taseko Mines Ltd, 7.000%, 15/02/26	146 763	0,03
				175 000 USD	Teine Energy Ltd, 6.875%, 15/04/29	163 748	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Canada (suite)				Îles Caïmans (suite)			
49 000 USD	Telesat Canada / Telesat LLC, 5.625%, 06/12/26	30 671	0,01	50 000 USD	MAF Global Securities Ltd, 7.875%, perpetual	50 868	0,01
25 000 USD	Telesat Canada / Telesat LLC, 4.875%, 01/06/27	14 774	0,00	250 000 USD	Melco Resorts Finance Ltd, 4.875%, 06/06/25	242 500	0,05
197 000 USD	Telesat Canada / Telesat LLC, 6.500%, 15/10/27	92 088	0,02	250 000 USD	Melco Resorts Finance Ltd, 5.250%, 26/04/26	240 625	0,05
240 000 USD	TransAlta Corp, 7.750%, 15/11/29	254 673	0,05	250 000 USD	Melco Resorts Finance Ltd, 5.625%, 17/07/27	231 873	0,04
20 000 CAD	TransAlta Corp, 6.900%, 15/11/30	15 717	0,00	350 000 USD	Melco Resorts Finance Ltd, 5.750%, 21/07/28	321 076	0,06
49 000 USD	TransAlta Corp, 6.500%, 15/03/40	48 978	0,01	450 000 USD	Melco Resorts Finance Ltd, 5.375%, 04/12/29	396 166	0,08
45 000 USD	Vermilion Energy Inc, 5.625%, 15/03/25	44 437	0,01	25 000 USD	MGM China Holdings Ltd, 5.250%, 18/06/25	24 531	0,00
230 000 USD	Vermilion Energy Inc, 6.875%, 01/05/30	220 735	0,04	300 000 USD	MGM China Holdings Ltd, 5.875%, 15/05/26	293 216	0,06
75 000 CAD	Videotron Ltd, 5.625%, 15/06/25	56 921	0,01	200 000 USD	MGM China Holdings Ltd, 4.750%, 01/02/27	190 250	0,04
149 000 USD	Videotron Ltd, 5.125%, 15/04/27	146 765	0,03	50 000 USD	OmGrid Funding Ltd, 5.196%, 16/05/27	49 681	0,01
200 000 CAD	Videotron Ltd, 3.625%, 15/06/28	140 755	0,03	200 000 USD	Oryx Funding Ltd, 5.800%, 03/02/31	200 313	0,04
101 000 USD	Videotron Ltd, 3.625%, 15/06/29	91 661	0,02	170 500 USD	Poinsettia Finance Ltd, 6.625%, 17/06/31	144 357	0,03
300 000 CAD	Videotron Ltd, 4.500%, 15/01/30	214 148	0,04	200 000 USD	Powerlong Real Estate Holdings Ltd, 5.950%, 30/04/25	17 000	0,00
150 000 CAD	Videotron Ltd, 3.125%, 15/01/31	97 013	0,02	100 000 USD	Sable International Finance Ltd, 5.750%, 07/09/27	94 453	0,02
Canada – Total		22 095 434	4,22	80 000 USD	Seagate HDD Cayman, 4.875%, 01/06/27	78 481	0,01
Îles Caïmans				170 000 USD	Seagate HDD Cayman, 4.091%, 01/06/29	157 268	0,03
250 000 USD	Arabian Centres Sukuk II Ltd, 5.625%, 07/10/26	228 450	0,04	27 000 USD	Seagate HDD Cayman, 4.125%, 15/01/31	24 119	0,00
200 000 USD	Arada Sukuk Ltd, 8.125%, 08/06/27	201 944	0,04	100 000 USD	Seagate HDD Cayman, 8.500%, 15/07/31	108 552	0,02
450 000 USD	CSN Inova Ventures, 6.750%, 28/01/28	439 450	0,08	307 760 USD	Seagate HDD Cayman, 9.625%, 01/12/32	351 924	0,07
200 000 USD	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd, 6.750%, 15/02/25	198 554	0,04	100 000 USD	Seagate HDD Cayman, 5.750%, 01/12/34	95 985	0,02
200 000 USD	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd, 6.875%, 26/02/27	197 260	0,04	86 000 USD	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 8.000%, 20/09/25	61 225	0,01
131 000 USD	Diamond Foreign Asset Co / Diamond Finance LLC, 8.500%, 01/10/30	133 816	0,02	200 000 USD	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 8.000%, 20/09/25	142 384	0,03
200 000 USD	DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd, 6.250%, perpetual	198 806	0,04	155 000 USD	Termocandelaria Power Ltd, 7.875%, 30/01/29	151 025	0,03
450 000 USD	DP World Salaam, 6.000%, perpetual	448 190	0,09	232 000 USD	Transocean Aquila Ltd, 8.000%, 30/09/28	235 442	0,04
200 000 USD	eHi Car Services Ltd, 7.750%, 14/11/24	172 500	0,03	100 000 USD	Transocean Inc, 7.250%, 01/11/25	98 500	0,02
200 000 USD	GFH Sukuk Ltd, 7.500%, 28/01/25	195 414	0,04	108 000 USD	Transocean Inc, 7.500%, 15/01/26	106 114	0,02
250 000 USD	GGAM Finance Ltd, 7.750%, 15/05/26	253 750	0,05	296 000 USD	Transocean Inc, 11.500%, 30/01/27	309 320	0,06
200 000 USD	GGAM Finance Ltd, 8.000%, 15/06/28	206 920	0,04	204 000 USD	Transocean Inc, 8.000%, 01/02/27	198 900	0,04
274 389 USD	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6.500%, 15/09/24	257 926	0,05	309 700 USD	Transocean Inc, 8.750%, 15/02/30	323 633	0,06
150 000 USD	Grupo Aval Ltd, 4.375%, 04/02/30	127 368	0,02	150 000 USD	Transocean Inc, 6.800%, 15/03/38	120 233	0,02
300 000 USD	IHS Holding Ltd, 5.625%, 29/11/26	260 322	0,05	100 000 USD	Transocean Inc, 7.500%, perpetual	88 000	0,02
400 000 USD	Lamar Funding Ltd, 3.958%, 07/05/25	389 164	0,07				
100 000 USD	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance, 10.875%, 15/01/31	102 325	0,02				
200 000 USD	MAF Global Securities Ltd, 6.375%, perpetual	196 104	0,04				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				
Îles Caïmans (suite)				Colombie (suite)				
204 000 USD	Transocean Poseidon Ltd, 6.875%, 01/02/27	202 987	0,04	250 000 USD	Grupo de Inversiones Suramericana SA, 5.500%, 29/04/26	245 281	0,05	
150 000 USD	Transocean Titan Financing Ltd, 8.375%, 01/02/28	155 623	0,03	200 000 USD	Oleoducto Central SA, 4.000%, 14/07/27	185 742	0,04	
100 000 EUR	UPCB Finance VII Ltd, 3.625%, 15/06/29	105 218	0,02	Colombie – Total			4 503 950	0,86
370 000 USD	Wynn Macau Ltd, 5.500%, 15/01/26	361 074	0,07	Costa Rica				
300 000 USD	Wynn Macau Ltd, 5.500%, 01/10/27	283 208	0,05	200 000 USD	Instituto Costarricense de Electricidad, 6.375%, 15/05/43	178 400	0,03	
525 000 USD	Wynn Macau Ltd, 5.625%, 26/08/28	486 495	0,09	Costa Rica – Total			178 400	0,03
250 000 USD	Wynn Macau Ltd, 5.125%, 15/12/29	222 058	0,04	Chypre				
150 000 USD	XP Inc, 3.250%, 01/07/26	140 672	0,03	200 000 EUR	Bank of Cyprus Pcl, 7.375%, 25/07/28	227 558	0,04	
Îles Caïmans – Total			2,16	Chypre – Total			227 558	0,04
Chili				République tchèque				
150 000 USD	Agrosuper SA, 4.600%, 20/01/32	128 547	0,02	100 000 EUR	Allwyn International AS, 3.875%, 15/02/27	106 046	0,02	
50 000 USD	CAP SA, 3.900%, 27/04/31	38 700	0,01	200 000 USD	Energo-Pro AS, 8.500%, 04/02/27	195 914	0,04	
150 000 USD	Latam Airlines Group SA, 13.375%, 15/10/27	167 654	0,03	200 000 USD	Energo-Pro AS, 11.000%, 02/11/28	206 340	0,04	
300 000 USD	Latam Airlines Group SA, 13.375%, 15/10/29	343 387	0,07	300 000 EUR	EP Infrastructure AS, 2.045%, 09/10/28	274 157	0,05	
Chili – Total			0,13	100 000 EUR	EP Infrastructure AS, 1.816%, 02/03/31	84 813	0,02	
Chine				République tchèque – Total			867 270	0,17
850 000 USD	Bank of Communications Co Ltd, 3.800%, perpetual	817 010	0,16	Danemark				
200 000 USD	Greentown China Holdings Ltd, 4.700%, 29/04/25	173 434	0,03	253 000 USD	Welltec International ApS, 8.250%, 15/10/26	256 912	0,05	
Chine – Total			0,19	Danemark – Total			256 912	0,05
Colombie				République dominicaine				
100 000 USD	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4.875%, 21/04/25	97 375	0,02	200 000 USD	Empresa Generadora de Electricidad Haina SA, 5.625%, 08/11/28	180 500	0,03	
200 000 USD	Banco de Bogota SA, 6.250%, 12/05/26	197 400	0,04	République dominicaine – Total			180 500	0,03
150 000 USD	Banco GNB Sudameris SA, 7.500%, 16/04/31	125 153	0,02	Finlande				
60 000 USD	Colombia Telecomunicaciones SA ESP, 4.950%, 17/07/30	37 168	0,01	274 000 USD	Ahlstrom Holding 3 Oyj, 4.875%, 04/02/28	239 256	0,05	
400 000 USD	Ecopetrol SA, 8.625%, 19/01/29	426 233	0,08	100 000 EUR	Citycon Oyj, 3.625%, perpetual	66 880	0,01	
650 000 USD	Ecopetrol SA, 6.875%, 29/04/30	644 015	0,12	100 000 EUR	Huhtamaki Oyj, 4.250%, 09/06/27	110 715	0,02	
350 000 USD	Ecopetrol SA, 4.625%, 02/11/31	296 878	0,06	200 000 EUR	Huhtamaki Oyj, 5.125%, 24/11/28	229 960	0,04	
650 000 USD	Ecopetrol SA, 8.875%, 13/01/33	706 328	0,13	100 000 EUR	SBB Treasury Oyj, 0.750%, 14/12/28	65 701	0,01	
400 000 USD	Ecopetrol SA, 7.375%, 18/09/43	381 811	0,07	200 000 EUR	SBB Treasury Oyj, 1.125%, 26/11/29	129 552	0,03	
715 000 USD	Ecopetrol SA, 5.875%, 28/05/45	564 683	0,11	Finlande – Total			842 064	0,16
235 000 USD	Ecopetrol SA, 5.875%, 02/11/51	177 733	0,03	France				
300 000 USD	Empresas Publicas de Medellin ESP, 4.250%, 18/07/29	255 174	0,05	300 000 EUR	Accor SA, 7.250%, perpetual	360 392	0,07	
200 000 USD	Empresas Publicas de Medellin ESP, 4.375%, 15/02/31	162 976	0,03	100 000 EUR	Affelou Sas, 4.250%, 19/05/26	109 637	0,02	
				100 000 EUR	Altice France SA, 2.500%, 15/01/25	106 151	0,02	
				500 000 EUR	Altice France SA, 5.875%, 01/02/27	490 480	0,09	
				550 000 USD	Altice France SA, 8.125%, 01/02/27	506 959	0,10	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
France (suite)				France (suite)			
200 000	EUR Altice France SA, 3.375%, 15/01/28	174 081	0,03	200 000	EUR Electricite de France SA, 5.000%, perpetual	220 181	0,04
383 000	USD Altice France SA, 5.500%, 15/01/28	315 432	0,06	300 000	GBP Electricite de France SA, 6.000%, perpetual	371 260	0,07
60 000	USD Altice France SA, 5.125%, 15/01/29	46 652	0,01	400 000	USD Electricite de France SA, 9.125%, perpetual	446 560	0,09
100 000	EUR Altice France SA, 4.000%, 15/07/29	85 743	0,02	200 000	EUR Electricite De France SA, 2.625%, 31/12/99	196 059	0,04
700 000	USD Altice France SA, 5.125%, 15/07/29	543 616	0,10	200 000	EUR Elior Group SA, 3.750%, 15/07/26	203 538	0,04
200 000	EUR Altice France SA, 4.250%, 15/10/29	175 071	0,03	200 000	EUR Elis SA, 4.125%, 24/05/27	223 139	0,04
620 000	USD Altice France SA, 5.500%, 15/10/29	485 900	0,09	100 000	EUR Elis SA, 1.625%, 03/04/28	101 352	0,02
200 000	EUR Atos SE, 1.750%, 07/05/25	167 876	0,03	100 000	EUR Emeria SASU, 3.375%, 31/03/28	94 558	0,02
200 000	EUR Atos SE, 2.500%, 07/11/28	132 116	0,03	200 000	EUR Emeria SASU, 7.750%, 31/03/28	213 142	0,04
200 000	EUR Atos SE, 1.000%, 12/11/29	117 093	0,02	100 000	EUR Eramet SA, 5.875%, 21/05/25	111 302	0,02
200 000	EUR Banijay Entertainment SASU, 7.000%, 01/05/29	232 529	0,04	100 000	EUR Eramet SA, 7.000%, 22/05/28	112 219	0,02
200 000	USD Banijay Entertainment SASU, 8.125%, 01/05/29	206 174	0,04	200 000	EUR Eutelsat SA, 2.000%, 02/10/25	207 091	0,04
300 000	EUR Cab Selas, 3.375%, 01/02/28	294 572	0,06	100 000	EUR Eutelsat SA, 2.250%, 13/07/27	94 532	0,02
100 000	EUR Casino Guichard Perrachon SA, 3.580%, 07/02/25	552	0,00	200 000	EUR Eutelsat SA, 1.500%, 13/10/28	165 698	0,03
100 000	EUR Casino Guichard Perrachon SA, 4.048%, 05/08/26	552	0,00	100 000	EUR Fnac Darty SA, 2.625%, 30/05/26	105 273	0,02
100 000	EUR Casino Guichard Perrachon SA, 5.250%, 15/04/27	829	0,00	200 000	EUR Forvia SE, 3.125%, 15/06/26	216 511	0,04
300 000	EUR Cerba Healthcare SACA, 3.500%, 31/05/28	276 301	0,05	200 000	EUR Forvia SE, 7.250%, 15/06/26	233 910	0,05
300 000	USD Cgg SA, 8.750%, 01/04/27	273 264	0,05	300 000	EUR Forvia SE, 2.750%, 15/02/27	316 675	0,06
200 000	EUR Cgg SA, 7.750%, perpetual	202 804	0,04	500 000	EUR Forvia SE, 2.375%, 15/06/27	521 310	0,10
100 000	EUR Chrome Holdco SAS, 5.000%, 31/05/29	76 497	0,02	200 000	EUR Forvia SE, 3.750%, 15/06/28	216 211	0,04
100 000	USD Constellium SE, 5.875%, 15/02/26	99 351	0,02	100 000	EUR Forvia SE, 2.375%, 15/06/29	100 413	0,02
25 000	USD Constellium SE, 5.625%, 15/06/28	24 397	0,01	300 000	EUR Getlink SE, 3.500%, 30/10/25	327 648	0,06
65 000	USD Constellium SE, 3.750%, 15/04/29	58 960	0,01	100 000	EUR Goldstory SAS, 5.375%, 01/03/26	110 067	0,02
200 000	EUR Constellium SE, 3.125%, 15/07/29	202 703	0,04	100 000	EUR Iliad Holding SASU, 5.125%, 15/10/26	109 900	0,02
200 000	EUR Crown European Holdings SA, 2.875%, 01/02/26	216 676	0,04	350 000	USD Iliad Holding SASU, 6.500%, 15/10/26	349 315	0,07
200 000	EUR Crown European Holdings SA, 5.000%, 15/05/28	228 931	0,04	300 000	EUR Iliad Holding SASU, 5.625%, 15/10/28	332 210	0,06
100 000	EUR Crown European Holdings SA, 4.750%, 15/03/29	112 431	0,02	230 000	USD Iliad Holding SASU, 7.000%, 15/10/28	228 870	0,04
100 000	EUR Derichebourg SA, 2.250%, 15/07/28	103 184	0,02	100 000	EUR iliad SA, 1.875%, 25/04/25	107 032	0,02
400 000	EUR Electricite de France SA, 7.500%, perpetual	482 129	0,09	100 000	EUR iliad SA, 2.375%, 17/06/26	105 516	0,02
500 000	EUR Electricite de France SA, 5.375%, perpetual	553 186	0,11	300 000	EUR iliad SA, 5.375%, 14/06/27	339 680	0,07
200 000	GBP Electricite de France SA, 5.875%, perpetual	232 812	0,05	200 000	EUR iliad SA, 1.875%, 11/02/28	202 027	0,04
200 000	EUR Electricite de France SA, 2.875%, perpetual	204 428	0,04	100 000	EUR iliad SA, 5.375%, 15/02/29	113 227	0,02
200 000	EUR Electricite de France SA, 3.375%, perpetual	193 579	0,04	200 000	EUR iliad SA, 5.625%, 15/02/30	228 309	0,04
				100 000	EUR IM Group SAS, 8.000%, 01/03/28	86 141	0,02
				100 000	EUR Kapla Holding SAS, 3.375%, 15/12/26	106 814	0,02
				100 000	EUR La Financiere Atalian SASU, 5.125%, 15/05/25	80 860	0,02
				100 000	GBP La Financiere Atalian SASU, 6.625%, 15/05/25	93 050	0,02
				200 000	EUR La Poste SA, 3.125%, perpetual	211 541	0,04
				100 000	EUR Laboratoire Eimer Selas, 5.000%, 01/02/29	89 220	0,02
				100 000	EUR Loxam sas, 4.500%, 15/02/27	110 211	0,02
				200 000	EUR Loxam SAS, 3.750%, 15/07/26	218 070	0,04
				197 000	EUR Loxam SAS, 6.375%, 15/05/28	226 299	0,04
				100 000	EUR Loxam SAS, 6.375%, 31/05/29	114 331	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
France (suite)				Géorgie			
100 000 EUR	Mobilux Finance SAS, 4.250%, 15/07/28	99 860	0,02	200 000 USD	GEORGIAN RAILWAY JSC, 4.000%, perpetual	182 605	0,04
100 000 EUR	Nexans SA, 5.500%, 05/04/28	117 009	0,02	125 000 USD	Silknet JSC, 8.375%, 31/01/27	124 375	0,02
100 000 EUR	Novafives SAS, 5.000%, 15/06/25	108 516	0,02	Géorgie – Total			
200 000 EUR	Paprec Holding SA, 6.500%, 17/11/27	236 042	0,05	306 980 0,06			
100 000 EUR	Paprec Holding SA, 7.250%, 17/11/29	118 336	0,02	Allemagne			
100 000 EUR	Parts Europe SA, 6.500%, 16/07/25	110 454	0,02	100 000 EUR	Adler Pelzer Holding GmbH, 9.500%, 01/04/27	109 915	0,02
200 000 EUR	Picard Groupe SAS, 3.875%, 01/07/26	214 827	0,04	100 000 EUR	ADLER Real Estate AG, 3.000%, 27/04/26	83 352	0,02
100 000 EUR	RCI Banque SA, 2.625%, 18/02/30	106 820	0,02	100 000 EUR	APCOA Parking Holdings GmbH, 4.625%, 15/01/27	103 585	0,02
400 000 EUR	Renault SA, 1.250%, 24/06/25	424 086	0,08	200 000 EUR	Bertelsmann SE & Co KGaA, 3.500%, 23/04/75	210 458	0,04
200 000 EUR	Renault SA, 1.000%, 28/11/25	210 094	0,04	100 000 EUR	BRANICKS Group AG, 2.250%, 22/09/26	37 789	0,01
100 000 EUR	Renault SA, 2.375%, 25/05/26	106 822	0,02	100 000 EUR	Ceconomy AG, 1.750%, 24/06/26	95 389	0,02
200 000 EUR	Renault SA, 2.000%, 28/09/26	210 538	0,04	200 000 USD	Cerdia Finanz GmbH, 10.500%, perpetual	203 524	0,04
100 000 EUR	Renault SA, 2.500%, 02/06/27	105 733	0,02	100 000 EUR	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 3.500%, 11/02/27	106 735	0,02
200 000 EUR	Renault SA, 1.125%, 04/10/27	201 568	0,04	250 000 EUR	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4.375%, 15/01/28	268 621	0,05
200 000 EUR	Renault SA, 2.500%, 01/04/28	211 784	0,04	200 000 USD	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 5.500%, 15/01/28	189 250	0,04
200 000 EUR	Rexel SA, 2.125%, 15/06/28	208 017	0,04	200 000 EUR	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 7.500%, 15/05/30	234 974	0,05
200 000 EUR	Rexel SA, 5.250%, 15/09/30	230 134	0,04	150 000 EUR	Commerzbank AG, 4.000%, 30/03/27	167 769	0,03
100 000 EUR	Seche Environnement SACA, 2.250%, 15/11/28	99 215	0,02	100 000 EUR	Commerzbank AG, 1.375%, 29/12/31	98 760	0,02
200 000 EUR	SNF Group SACA, 2.000%, 01/02/26	212 980	0,04	200 000 EUR	Commerzbank AG, 6.500%, 06/12/32	232 480	0,04
60 000 USD	SNF Group SACA, 3.125%, 15/03/27	54 621	0,01	200 000 GBP	Commerzbank AG, 8.625%, 28/02/33	270 831	0,05
70 000 USD	SNF Group SACA, 3.375%, 15/03/30	60 102	0,01	500 000 EUR	Commerzbank AG, 6.750%, 05/10/33	587 784	0,11
200 000 EUR	Spie SA, 2.625%, 18/06/26	215 379	0,04	100 000 EUR	CT Investment GmbH, 5.500%, 15/04/26	109 592	0,02
100 000 EUR	Tereos Finance Groupe I SA, 4.750%, 30/04/27	111 128	0,02	100 000 EUR	Ctec II GmbH, 5.250%, 15/02/30	98 590	0,02
200 000 EUR	Tereos Finance Groupe I SA, 7.250%, 15/04/28	233 832	0,05	200 000 EUR	Deutsche Lufthansa AG, 3.000%, 29/05/26	214 868	0,04
200 000 EUR	Valeo SE, 1.625%, 18/03/26	212 347	0,04	200 000 EUR	Deutsche Lufthansa AG, 2.875%, 16/05/27	212 221	0,04
200 000 EUR	Valeo SE, 5.375%, 28/05/27	229 373	0,04	200 000 EUR	Deutsche Lufthansa AG, 2.875%, perpetual	216 682	0,04
100 000 EUR	Valeo SE, 1.000%, 03/08/28	96 791	0,02	300 000 EUR	Deutsche Lufthansa AG, 3.750%, perpetual	326 531	0,06
300 000 EUR	Valeo SE, 5.875%, 12/04/29	355 713	0,07	100 000 EUR	Deutsche Lufthansa AG, 3.500%, perpetual	107 400	0,02
300 000 EUR	Vallourec SACA, 8.500%, 30/06/26	333 010	0,06	300 000 EUR	Douglas GmbH, 6.000%, 08/04/26	327 117	0,06
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 1.625%, perpetual	101 833	0,02	100 000 EUR	Evonik Industries AG, 1.375%, 02/09/81	97 614	0,02
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 2.000%, perpetual	197 456	0,04	200 000 EUR	Gruenthal GmbH, 4.125%, 15/05/28	218 121	0,04
200 000 EUR	Veolia Environnement SA, 2.250%, perpetual	208 330	0,04	200 000 EUR	Gruenthal GmbH, 6.750%, 15/05/30	233 910	0,04
300 000 EUR	Veolia Environnement SA, 2.500%, perpetual	296 229	0,06	France – Total			
100 000 EUR	Veolia Environnement SA, 5.993%, perpetual	115 990	0,02	22 610 281 4,32			

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				
Allemagne (suite)				Allemagne (suite)				
125 000	EUR Hapag-Lloyd AG, 2.500%, 15/04/28	128 802	0,02	100 000	EUR ZF Finance GmbH, 2.750%, 25/05/27	104 942	0,02	
200 000	EUR HT Troplast GmbH, 9.375%, 15/07/28	224 105	0,04	100 000	EUR ZF Finance GmbH, 2.250%, 03/05/28	101 214	0,02	
250 000	USD IHO Verwaltungs GmbH, 4.750%, 15/09/26	239 375	0,05	300 000	EUR ZF Finance GmbH, 3.750%, 21/09/28	319 204	0,06	
150 000	EUR IHO Verwaltungs GmbH, 3.875%, 15/05/27	161 853	0,03	Allemagne – Total			11 884 526	2,27
150 000	USD IHO Verwaltungs GmbH, 6.000%, 15/05/27	146 149	0,03	Gibraltar				
400 000	EUR IHO Verwaltungs GmbH, 8.750%, 15/05/28	480 492	0,09	200 000	EUR 888 Acquisitions Ltd, 7.558%, 15/07/27	211 541	0,04	
50 000	USD IHO Verwaltungs GmbH, 6.375%, 15/05/29	49 066	0,01	Gibraltar – Total			211 541	0,04
100 000	EUR INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH, 2.250%, 16/01/27	101 539	0,02	Grèce				
100 000	EUR Infineon Technologies AG, 2.875%, perpetual	107 703	0,02	100 000	EUR Alpha Bank SA, 7.500%, 16/06/27	117 060	0,02	
200 000	EUR Infineon Technologies AG, 3.625%, perpetual	211 498	0,04	100 000	EUR Alpha Bank SA, 2.500%, 23/03/28	102 318	0,02	
304 500	EUR Kirk Beauty SUN GmbH, 8.250%, perpetual	325 602	0,06	300 000	EUR Alpha Bank SA, 6.875%, 27/06/29	351 942	0,07	
100 000	EUR Mahle GmbH, 2.375%, 14/05/28	94 030	0,02	100 000	EUR Alpha Services and Holdings SA, 4.250%, 13/02/30	107 703	0,02	
400 000	EUR Nidda Healthcare Holding GmbH, 7.500%, 21/08/26	454 558	0,09	100 000	EUR Alpha Services and Holdings SA, 5.500%, 11/06/31	107 179	0,02	
200 000	EUR Novelis Sheet Ingot GmbH, 3.375%, 15/04/29	208 339	0,04	200 000	EUR Eurobank SA, 2.000%, 05/05/27	209 055	0,04	
100 000	EUR PCF GmbH, 4.750%, 15/04/26	79 934	0,02	100 000	EUR Eurobank SA, 2.250%, 14/03/28	102 705	0,02	
100 000	EUR Peach Property Finance GmbH, 4.375%, 15/11/25	86 524	0,02	200 000	EUR Eurobank SA, 7.000%, 26/01/29	237 898	0,05	
200 000	EUR ProGroup AG, 3.000%, 31/03/26	213 750	0,04	125 000	EUR Eurobank SA, 5.875%, 28/11/29	142 653	0,03	
100 000	EUR Renk AG/Frankfurt am Main, 5.750%, 15/07/25	109 642	0,02	300 000	EUR Mytilineos SA, 2.250%, 30/10/26	316 018	0,06	
100 000	EUR Schaeffler AG, 2.750%, 12/10/25	108 194	0,02	100 000	EUR National Bank of Greece SA, 2.750%, 08/10/26	107 705	0,02	
240 000	EUR Schaeffler AG, 2.875%, 26/03/27	260 553	0,05	100 000	GBP National Bank of Greece SA, 8.750%, 02/06/27	131 559	0,02	
200 000	EUR Schaeffler AG, 3.375%, 12/10/28	213 750	0,04	100 000	EUR National Bank of Greece SA, 7.250%, 22/11/27	118 980	0,02	
87 920	EUR Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH, 6.000%, 30/07/26	96 635	0,02	300 000	EUR Piraeus Bank SA, 7.250%, 13/07/28	346 817	0,07	
400 000	EUR Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.000%, 15/07/25	431 425	0,08	100 000	EUR Piraeus Bank SA, 6.750%, 05/12/29	115 835	0,02	
100 000	EUR Tele Columbus AG, 3.875%, 02/05/25	69 924	0,01	200 000	EUR Piraeus Financial Holdings SA, 5.500%, perpetual	215 793	0,04	
100 000	EUR thyssenkrupp AG, 2.500%, 25/02/25	108 522	0,02	Grèce – Total			2 831 220	0,54
175 000	USD TK Elevator Holdco GmbH, 7.625%, 15/07/28	171 901	0,03	Guatemala				
180 000	EUR TK Elevator Holdco GmbH, 6.625%, perpetual	182 944	0,04	175 000	USD Banco Industrial SA/Guatemala, 4.875%, 29/01/31	164 351	0,03	
300 000	EUR TK Elevator Midco GmbH, 4.375%, 15/07/27	320 393	0,06	225 000	USD CT Trust, 5.125%, 03/02/32	196 604	0,04	
125 000	EUR Tui Cruises GmbH, 6.500%, 15/05/26	136 010	0,03	Guatemala – Total			360 955	0,07
200 000	EUR ZF Finance GmbH, 3.000%, 21/09/25	215 871	0,04	Guernesey				
400 000	EUR ZF Finance GmbH, 5.750%, 03/08/26	456 221	0,09	200 000	EUR Globalworth Real Estate Investments Ltd, 3.000%, 29/03/25	201 997	0,04	
				100 000	EUR Globalworth Real Estate Investments Ltd, 2.950%, 29/07/26	90 431	0,02	
				Guernesey – Total			292 428	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Hong Kong				Irlande (suite)			
250 000	USD Bank of East Asia Ltd, 5.825%, perpetual	217 500	0,04	200 000	EUR Eircom Finance Dac, 3.500%, 15/05/26	214 623	0,04
178 000	USD Seaspan Corp, 5.500%, 01/08/29	148 911	0,03	200 000	EUR Energia Group Roi Financeco DAC, 6.875%, 31/07/28	228 795	0,04
Hong-Kong – Total				173 000 USD GGAM Finance Ltd, 8.000%, 15/02/27			
Hongrie				125 000 EUR James Hardie International Finance DAC, 3.625%, 01/10/26			
100 000	EUR MBH Bank Nyrt, 8.625%, 19/10/27	115 529	0,02	275 000	USD James Hardie International Finance DAC, 5.000%, 15/01/28	266 017	0,05
250 000	USD OTP Bank Nyrt, 8.750%, 15/05/33	256 875	0,05	285 000	USD Jazz Securities DAC, 4.375%, 15/01/29	265 462	0,05
Hongrie – Total				315 000 USD LCPR Senior Secured Financing DAC, 6.750%, 15/10/27			
Inde				150 000 USD LCPR Senior Secured Financing DAC, 5.125%, 15/07/29			
200 000	USD Adani Green Energy UP Ltd / Prayatna Developers Pvt Ltd / Parampujya Solar Energ, 6.250%, perpetual	197 491	0,04	100 000	EUR Motion Bondco DAC, 4.500%, 15/11/27	100 124	0,02
188 394	USD Adani Renewable Energy RJ Ltd/Kodangal Solar Parks Pvt Ltd/Wardha Solar Maharash, 4.625%, 15/10/39	147 384	0,03	125 000	USD Motion Bondco DAC, 6.625%, 15/11/27	115 565	0,02
280 000	USD Delhi International Airport Ltd, 6.450%, 04/06/29	273 420	0,05	50 000	EUR Permanent TSB Group Holdings PLC, 3.000%, 19/08/31	51 919	0,01
250 000	USD Future Retail Ltd, 5.600%, 22/01/25	625	0,00	150 000	USD Perrigo Finance Unlimited Co, 4.375%, 15/03/26	144 969	0,03
150 000	USD GMR Hyderabad International Airport Ltd, 4.750%, 02/02/26	143 977	0,03	325 000	USD Perrigo Finance Unlimited Co, 4.650%, 15/06/30	295 598	0,06
200 000	USD HPCL-Mittal Energy Ltd, 5.250%, perpetual	191 193	0,04	50 000	USD Perrigo Finance Unlimited Co, 4.900%, 15/12/44	39 394	0,01
200 000	USD JSW Steel Ltd, 3.950%, 05/04/27	184 714	0,03	325 000	GBP Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC, 4.875%, 15/07/28	380 693	0,07
220 000	USD Network i2i Ltd, 3.975%, perpetual	204 050	0,04	94 000	USD Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC, 5.000%, 15/07/28	88 285	0,02
200 000	USD ReNew Pvt Ltd, 5.875%, 05/03/27	190 480	0,04	Irlande – Total			
50 000	USD ReNew Wind Energy AP2 / ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries, 4.500%, 14/07/28	44 477	0,01	3 954 705			
200 000	USD TML HOLDINGS PTE LTD, 4.350%, perpetual	189 080	0,03	0,75			
Inde – Total				Ile de Man			
				45 000 USD AngloGold Ashanti Holdings PLC, 6.500%, 15/04/40			
				200 000 EUR Playtech PLC, 5.875%, 28/06/28			
				Ile de Man – Total			
				263 852			
				0,05			
Indonésie				Israël			
150 000	USD Alam Sutera Realty Tbk PT, 12.000%, 02/11/25	138 270	0,03	300 000	USD Energian Israel Finance Ltd, 4.875%, 30/03/26	276 000	0,05
170 000	USD Bukit Makmur Mandiri Utama PT, 7.750%, 10/02/26	160 446	0,03	300 000	USD Energian Israel Finance Ltd, 5.375%, 30/03/28	263 325	0,05
250 000	USD Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT, 5.375%, 23/03/26	217 453	0,04	80 000	USD Energian Israel Finance Ltd, 5.875%, 30/03/31	67 416	0,01
Indonésie – Total				300 000 USD Energian Israel Finance Ltd, 8.500%, 30/09/33			
				300 000 USD Leviathan Bond Ltd, 6.125%, 30/06/25			
				200 000 USD Leviathan Bond Ltd, 6.500%, 30/06/27			
				150 000 USD Leviathan Bond Ltd, 6.750%, 30/06/30			
				Israël – Total			
				1 507 311			
				0,29			
Irlande							
200 000	USD Aragvi Finance International DAC, 8.450%, 29/04/26	137 304	0,03				
100 000	EUR Bank of Cyprus Holdings PLC, 6.625%, 23/10/31	107 944	0,02				
325 000	USD C&W Senior Financing DAC, 6.875%, 15/09/27	302 803	0,06				
175 000	USD Castllake Aviation Finance DAC, 5.000%, 15/04/27	163 829	0,03				
200 000	USD Cimpress PLC, 7.000%, 15/06/26	195 500	0,04				
100 000	EUR eircom Finance DAC, 2.625%, 15/02/27	103 756	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Italie				Italie (suite)			
100 000	EUR Almagora - The Italian Innovation Co SpA, 4.875%, 30/10/26	108 824	0,02	200 000	EUR IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3.750%, 15/01/28	205 639	0,04
225 000	EUR Amplifon SpA, 1.125%, 13/02/27	228 705	0,04	100 000	EUR Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA, 5.500%, 17/05/27	99 419	0,02
100 000	EUR Azzurra Aeroporti SpA, 2.625%, 30/05/27	102 839	0,02	300 000	EUR Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1.875%, 08/07/26	318 370	0,06
100 000	EUR Banca IFIS SpA, 6.125%, 19/01/27	112 685	0,02	200 000	EUR Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1.625%, 21/10/28	204 122	0,04
100 000	EUR Banca IFIS SpA, 6.875%, 13/09/28	115 436	0,02	100 000	EUR Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1.750%, 19/04/31	98 778	0,02
200 000	EUR Banca Popolare di Sondrio SPA, 1.250%, 13/07/27	205 951	0,04	100 000	EUR Inter Media and Communication SpA, 6.750%, 09/02/27	106 120	0,02
100 000	EUR Banca Popolare di Sondrio SPA, 5.500%, 26/09/28	114 156	0,02	200 000	EUR International Design Group SPA, 10.000%, 15/11/28	229 332	0,04
100 000	EUR Banca Popolare di Sondrio SPA, 3.875%, 25/02/32	103 693	0,02	450 000	USD Intesa Sanpaolo SpA, 5.710%, 15/01/26	447 834	0,09
150 000	EUR Banco BPM SpA, 6.000%, 21/01/28	173 434	0,03	200 000	EUR Intesa Sanpaolo SpA, 3.928%, 15/09/26	221 398	0,04
350 000	EUR Banco BPM SpA, 6.000%, 14/06/28	404 458	0,08	100 000	GBP Intesa Sanpaolo SpA, 5.148%, 10/06/30	115 262	0,02
100 000	EUR Banco BPM SpA, 5.000%, 14/09/30	111 805	0,02	110 000	USD Intesa Sanpaolo SpA, 4.198%, 01/06/32	90 916	0,02
100 000	EUR Banco BPM SpA, 3.250%, 14/01/31	107 427	0,02	600 000	EUR Intesa Sanpaolo SpA, 6.184%, 20/02/34	699 560	0,13
200 000	EUR Banco BPM SpA, 3.375%, 19/01/32	208 611	0,04	325 000	USD Intesa Sanpaolo SpA, 4.950%, 01/06/42	231 709	0,05
100 000	EUR BPER Banca, 1.875%, 07/07/25	107 237	0,02	250 000	EUR Intesa Sanpaolo Vita SpA, 2.375%, 22/12/30	221 093	0,04
100 000	EUR BPER Banca, 1.375%, 31/03/27	105 114	0,02	100 000	EUR Italmatch Chemicals SpA, 10.000%, 06/02/28	113 630	0,02
150 000	EUR BPER Banca, 6.125%, 01/02/28	174 779	0,03	100 000	EUR Itelyum Regeneration Spa, 4.625%, 01/10/26	104 323	0,02
300 000	EUR BPER Banca, 5.750%, 11/09/29	342 281	0,07	250 000	USD Kedrion SpA, 6.500%, 01/09/29	227 500	0,04
100 000	EUR BPER Banca, 3.625%, 30/11/30	108 195	0,02	200 000	EUR Lottomatica SpA/Roma, 9.750%, 30/09/27	238 936	0,05
200 000	EUR BPER Banca, 3.875%, 25/07/32	206 649	0,04	100 000	EUR Lottomatica SpA/Roma, 7.125%, 01/06/28	116 320	0,02
100 000	EUR Castor SpA, 6.000%, 15/02/29	100 391	0,02	125 000	EUR Marcolin SpA, 6.125%, 15/11/26	131 742	0,03
150 000	EUR Credito Emiliano SpA, 5.625%, 30/05/29	173 240	0,03	250 000	EUR Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 2.300%, 23/11/30	263 045	0,05
100 000	EUR doValue SpA, 5.000%, 04/08/25	107 808	0,02	200 000	EUR Mundys SpA, 1.625%, 03/02/25	214 358	0,04
100 000	EUR Engineering - Ingegneria Informatica - SpA, 5.875%, 30/09/26	107 996	0,02	250 000	EUR Mundys SpA, 1.875%, 13/07/27	257 428	0,05
200 000	EUR Engineering - Ingegneria Informatica - SpA, 11.125%, 15/05/28	235 837	0,05	150 000	EUR Mundys SpA, 1.875%, 12/02/28	151 623	0,03
100 000	EUR Eolo SpA, 4.875%, 21/10/28	84 608	0,02	300 000	EUR Nexi SpA, 1.625%, 30/04/26	314 182	0,06
200 000	EUR Esselunga SpA, 1.875%, 25/10/27	207 123	0,04	225 000	EUR Nexi SpA, 2.125%, 30/04/29	218 852	0,04
100 000	EUR Fiber Bidco SpA, 11.000%, 25/10/27	120 407	0,02	100 000	EUR Piaggio & C SpA, 6.500%, 05/10/30	116 470	0,02
100 000	EUR FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA, 5.625%, 01/08/27	102 456	0,02	200 000	EUR Poste Italiane Spa, 2.625%, 31/12/99	181 426	0,04
100 000	EUR Guala Closures SpA, 3.250%, 15/06/28	103 561	0,02	125 000	EUR Rekeep SpA, 7.250%, 01/02/26	123 426	0,02
100 000	EUR Iccrea Banca SpA, 6.375%, 20/09/27	116 349	0,02	100 000	EUR SACE SpA, 3.875%, perpetual	103 923	0,02
300 000	EUR Iccrea Banca SpA, 6.875%, 20/01/28	357 453	0,07	100 000	EUR Shiba Bidco SpA, 4.500%, 31/10/28	103 319	0,02
100 000	EUR Iccrea Banca SpA, 4.750%, 18/01/32	106 122	0,02	100 000	EUR TeamSystem SpA, 3.500%, 15/02/28	101 988	0,02
100 000	EUR Illimity Bank SpA, 6.625%, 09/12/25	113 061	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				
Italie (suite)				Japon (suite)				
150 000 EUR	Telecom Italia SpA/Milano, 2.750%, 15/04/25	161 157	0,03	200 000 USD	SoftBank Group Corp, 4.625%, 06/07/28	182 913	0,03	
250 000 EUR	Telecom Italia SpA/Milano, 3.000%, 30/09/25	268 906	0,05	100 000 EUR	SoftBank Group Corp, 4.000%, 19/09/29	100 585	0,02	
200 000 EUR	Telecom Italia SpA/Milano, 2.875%, 28/01/26	213 355	0,04	450 000 USD	SoftBank Group Corp, 5.250%, 06/07/31	401 760	0,08	
200 000 EUR	Telecom Italia SpA/Milano, 3.625%, 25/05/26	216 974	0,04	300 000 EUR	SoftBank Group Corp, 3.875%, 06/07/32	282 630	0,05	
500 000 EUR	Telecom Italia SpA/Milano, 6.875%, 15/02/28	586 958	0,11	400 000 USD	SoftBank Group Corp, 6.875%, perpetual	381 400	0,07	
800 000 EUR	Telecom Italia SpA/Milano, 7.875%, 31/07/28	980 046	0,19	125 000 USD	Universal Entertainment Corp, 8.750%, 11/12/24	134 243	0,03	
100 000 EUR	Telecom Italia SpA/Milano, 1.625%, 18/01/29	95 179	0,02	Japon – Total			4 188 485	0,80
100 000 EUR	Telecom Italia SpA/Milano, 5.250%, 17/03/55	101 778	0,02	Jersey				
200 000 EUR	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2.375%, perpetual	197 416	0,04	150 000 USD	Adient Global Holdings Ltd, 4.875%, 15/08/26	146 718	0,03	
400 000 EUR	UniCredit SpA, 2.731%, 15/01/32	414 200	0,08	142 000 USD	Adient Global Holdings Ltd, 7.000%, 15/04/28	146 817	0,03	
356 000 USD	UniCredit SpA, 5.861%, 19/06/32	348 488	0,07	63 000 USD	Adient Global Holdings Ltd, 8.250%, 15/04/31	66 699	0,01	
200 000 USD	UniCredit SpA, 7.296%, 02/04/34	205 814	0,04	420 000 USD	Aston Martin Capital Holdings Ltd, 10.500%, 30/11/25	424 042	0,08	
575 000 USD	UniCredit SpA, 5.459%, 30/06/35	541 227	0,10	6 891 USD	Aston Martin Capital Holdings Ltd, 15.000%, 30/11/26	7 450	0,00	
100 000 EUR	UnipolSai Assicurazioni SpA, 3.875%, 01/03/28	108 723	0,02	138 000 EUR	Avis Budget Finance Plc, 7.250%, 31/07/30	163 088	0,03	
100 000 EUR	Webuild SpA, 3.875%, 28/07/26	108 119	0,02	100 000 EUR	Avis Budget Finance PLC, 4.750%, 30/01/26	110 183	0,02	
100 000 EUR	Webuild SpA, 3.625%, 28/01/27	104 557	0,02	100 000 EUR	G City Europe Ltd, 4.250%, 11/09/25	100 883	0,02	
200 000 EUR	Webuild SpA, 7.000%, 27/09/28	231 826	0,05	100 000 EUR	G City Europe Ltd, 3.625%, perpetual	48 273	0,01	
Italie – Total			3,14	100 000 GBP	Galaxy Bidco Ltd, 6.500%, 31/07/26	123 018	0,02	
Japon				200 000 EUR	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd, 3.250%, 12/11/25	199 842	0,04	
200 000 USD	Rakuten Group Inc, 3.546%, 27/11/24	192 000	0,04	200 000 USD	Oriflame Investment Holding PLC, 5.125%, 04/05/26	57 000	0,01	
300 000 USD	Rakuten Group Inc, 10.250%, 30/11/24	306 000	0,06	100 000 GBP	TVL Finance PLC, 10.250%, 28/04/28	132 260	0,03	
400 000 EUR	Rakuten Group Inc, 4.250%, perpetual	292 508	0,06	200 000 USD	West China Cement Ltd, 4.950%, 08/07/26	144 289	0,03	
125 000 USD	Rakuten Group Inc, 5.125%, perpetual	98 861	0,02	100 000 GBP	Wheel Bidco Ltd, 6.750%, 15/07/26	108 473	0,02	
250 000 USD	Rakuten Group Inc, 6.250%, perpetual	168 156	0,03	Jersey – Total			1 979 035	0,38
125 000 USD	SoftBank Group Corp, 3.125%, 06/01/25	120 062	0,02	Liberia				
300 000 EUR	SoftBank Group Corp, 4.750%, 30/07/25	332 531	0,06	178 000 USD	Royal Caribbean Cruises Ltd, 5.500%, 31/08/26	176 320	0,03	
50 000 USD	SoftBank Group Corp, 6.000%, 30/07/25	49 320	0,01	438 000 USD	Royal Caribbean Cruises Ltd, 5.375%, 15/07/27	433 643	0,08	
200 000 EUR	SoftBank Group Corp, 3.125%, 19/09/25	213 179	0,04	423 000 USD	Royal Caribbean Cruises Ltd, 11.625%, 15/08/27	460 289	0,09	
200 000 USD	SoftBank Group Corp, 4.000%, 06/07/26	186 979	0,04	125 000 USD	Royal Caribbean Cruises Ltd, 7.500%, 15/10/27	131 479	0,03	
100 000 EUR	SoftBank Group Corp, 2.875%, 06/01/27	103 042	0,02	462 000 USD	Royal Caribbean Cruises Ltd, 5.500%, 01/04/28	456 216	0,09	
450 000 USD	SoftBank Group Corp, 5.125%, 19/09/27	424 179	0,08					
200 000 EUR	SoftBank Group Corp, 5.000%, 15/04/28	218 137	0,04					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Liberia (suite)				Lituanie (suite)			
367 000 USD	Royal Caribbean Cruises Ltd, 8.250%, 15/01/29	390 027	0,07	220 000 USD	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc, 5.250%, 15/08/27	170 735	0,03
150 000 USD	Royal Caribbean Cruises Ltd, 9.250%, 15/01/29	161 408	0,03	230 000 USD	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc, 5.250%, 15/08/27	178 496	0,03
150 000 USD	Royal Caribbean Cruises Ltd, 7.250%, 15/01/30	156 691	0,03				
Liberia – Total		2 366 073	0,45	200 000 USD	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4.050%, 27/04/26	181 000	0,03
Lituanie							
100 000 EUR	Akropolis Group Uab, 2.875%, 02/06/26	99 695	0,02	50 000 USD	Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV, 4.750%, 15/06/27	48 589	0,01
300 000 EUR	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 3.625%, 01/06/28	290 345	0,05	400 000 USD	Borr IHC Ltd / Borr Finance LLC, 10.000%, 15/11/28	416 000	0,08
335 000 USD	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 4.625%, 01/06/28	303 790	0,06	200 000 USD	Borr IHC Ltd / Borr Finance LLC, 10.375%, 15/11/30	206 000	0,04
170 000 USD	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 4.625%, 01/06/28	155 377	0,03	200 000 EUR	Canpack SA / Canpack US LLC, 2.375%, 01/11/27	201 179	0,04
731 667 USD	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.500%, 20/04/26	726 402	0,14	400 000 USD	Canpack SA / Canpack US LLC, 3.875%, 15/11/29	342 848	0,07
864 000 USD	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.750%, 20/04/29	841 935	0,16	75 000 USD	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 5.375%, 15/01/28	72 563	0,01
240 000 USD	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC, 6.000%, 15/06/27	239 095	0,05	200 000 EUR	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 4.375%, 15/05/26	219 049	0,04
150 000 EUR	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC, 2.000%, 01/09/28	146 715	0,03	160 000 USD	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 6.250%, 15/05/26	160 193	0,03
80 000 USD	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC, 3.250%, 01/09/28	69 992	0,01	336 000 USD	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 8.500%, 15/05/27	337 162	0,06
100 000 EUR	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC, 3.000%, 01/09/29	88 770	0,02	270 000 USD	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 6.750%, 15/05/28	275 462	0,05
475 000 USD	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC, 4.000%, 01/09/29	402 439	0,08	540 000 USD	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6.750%, 01/10/26	536 841	0,10
310 000 USD	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc, 5.250%, 30/04/25	301 482	0,06	200 000 USD	Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd, 8.750%, 25/05/24	187 096	0,04
100 000 EUR	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc, 2.125%, 15/08/26	98 182	0,02	100 000 USD	Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd, 8.750%, 25/05/24	93 548	0,02
200 000 EUR	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc, 2.125%, 15/08/26	196 437	0,04	100 000 USD	Eagle Intermediate Global Holding BV/Eagle US Finance LLC, 7.500%, 01/05/25	66 002	0,01
348 000 USD	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc, 4.125%, 15/08/26	317 550	0,06	250 000 USD	GEMS MENASA Cayman Ltd / GEMS Education Delaware LLC, 7.125%, 31/07/26	246 036	0,05
100 000 GBP	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc, 4.750%, 15/07/27	92 172	0,02	162 000 USD	Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc, 7.875%, 01/09/25	159 977	0,03
				175 000 USD	Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 10.750%, 01/07/25	172 812	0,03
				100 000 EUR	Paysafe Finance PLC / Paysafe Holdings US Corp, 3.000%, 15/06/29	99 750	0,02
				174 000 USD	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC, 7.750%, 15/04/26	175 096	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Lituanie (suite)				Luxembourg (suite)			
235 000 USD	VistaJet Malta Finance PLC / Vista Management Holding Inc, 7.875%, 01/05/27	202 293	0,04	125 000 EUR	Aramark International Finance Sarl, 3.125%, 01/04/25	136 903	0,03
100 000 USD	VistaJet Malta Finance PLC / Vista Management Holding Inc, 9.500%, 01/06/28	84 632	0,02	200 000 EUR	ARD Finance SA, 5.000%, 30/06/27	108 808	0,02
Lituanie – Total		9 203 737	1,76	340 000 USD	ARD Finance SA, 6.500%, 30/06/27	158 841	0,03
Luxembourg				100 000 EUR	Arena Luxembourg Finance Sarl, 1.875%, 01/02/28	98 688	0,02
117 794 USD	Acu Petroleo Luxembourg Sarl, 7.500%, perpetual	111 713	0,02	200 000 GBP	B&M European Value Retail SA, 4.000%, 15/11/28	235 858	0,04
84 000 USD	Adecoagro SA, 6.000%, 21/09/27	81 188	0,02	100 000 EUR	Birkenstock Financing Sarl, 5.250%, 30/04/29	109 380	0,02
300 000 EUR	Adler Financing Sarl, 12.500%, 30/06/25	348 462	0,07	120 000 USD	Camelot Finance SA, 4.500%, 01/11/26	117 242	0,02
250 000 USD	Aegea Finance Sarl, 6.750%, 20/05/29	245 649	0,05	200 000 EUR	Cidron Aida Finco Sarl, 5.000%, 01/04/28	212 476	0,04
250 000 USD	Aegea Finance Sarl, 9.000%, 20/01/31	265 616	0,05	100 000 EUR	Cirsa Finance International Sarl, 4.750%, 22/05/25	110 244	0,02
100 000 EUR	Agps Bondco PLC, 4.250%, 31/07/25	77 840	0,01	250 000 EUR	Cirsa Finance International Sarl, 10.375%, 30/11/27	300 846	0,06
100 000 EUR	Agps Bondco PLC, 4.625%, 14/01/26	38 166	0,01	100 000 EUR	Cirsa Finance International Sarl, 7.875%, 31/07/28	115 160	0,02
100 000 EUR	Agps Bondco PLC, 5.500%, 13/11/26	38 110	0,01	100 000 EUR	Codere Finance 2 Luxembourg SA, 11.000%, 30/09/26	64 070	0,01
200 000 EUR	Agps Bondco PLC, 5.000%, 27/04/27	72 907	0,01	150 000 USD	Consolidated Energy Finance SA, 5.625%, 15/10/28	127 017	0,02
100 000 EUR	Agps Bondco PLC, 5.000%, 14/01/29	35 238	0,01	100 000 EUR	ContourGlobal Power Holdings SA, 3.125%, 01/01/28	97 093	0,02
200 000 EUR	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc, 5.250%, 15/10/26	220 378	0,04	200 000 USD	Cosan Luxembourg SA, 7.500%, 27/06/30	208 808	0,04
187 000 USD	Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc, 6.125%, 15/10/26	185 235	0,04	100 000 EUR	CPI Property Group SA, 3.750%, 25/07/28	25 505	0,00
300 000 USD	Albion Financing 2 Sarl, 8.750%, 15/04/27	295 500	0,06	100 000 EUR	CPI Property Group SA, 4.875%, perpetual	31 743	0,01
100 000 EUR	Altice Financing SA, 2.250%, 15/01/25	107 164	0,02	100 000 EUR	CPI Property Group SA, 4.875%, perpetual	31 535	0,01
300 000 EUR	Altice Financing SA, 3.000%, 15/01/28	294 942	0,06	100 000 EUR	Cullinan Holdco Scsp, 4.625%, 15/10/26	85 887	0,02
300 000 USD	Altice Financing SA, 5.000%, 15/01/28	271 768	0,05	100 000 EUR	Dana Financing Luxembourg Sarl, 3.000%, 15/07/29	97 375	0,02
300 000 EUR	Altice Financing SA, 4.250%, 15/08/29	293 450	0,06	200 000 EUR	Dana Financing Luxembourg Sarl, 8.500%, 15/07/31	241 313	0,05
670 000 USD	Altice Financing SA, 5.750%, 15/08/29	595 148	0,11	100 000 EUR	Eurofins Scientific SE, 3.250%, perpetual	105 994	0,02
100 000 EUR	Altice Finco SA, 4.750%, 15/01/28	90 814	0,02	200 000 EUR	Eurofins Scientific SE, 6.750%, perpetual	229 627	0,04
450 000 EUR	Altice France Holding SA, 8.000%, 15/05/27	281 835	0,05	42 000 USD	FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 5.625%, 15/08/26	40 938	0,01
450 000 USD	Altice France Holding SA, 10.500%, 15/05/27	291 429	0,06	100 000 USD	FS Luxembourg Sarl, 10.000%, 15/12/25	102 552	0,02
100 000 EUR	Altice France Holding SA, 4.000%, 15/02/28	48 015	0,01	200 000 EUR	Garfunkelux Holdco 3 SA, 6.750%, 01/11/25	174 322	0,04
200 000 USD	Altice France Holding SA, 6.000%, 15/02/28	96 077	0,02	100 000 GBP	Garfunkelux Holdco 3 SA, 7.750%, 01/11/25	97 548	0,02
200 000 USD	Amaggi Luxembourg International Sarl, 5.250%, 28/01/28	191 957	0,04	120 000 USD	Gol Finance SA, 7.000%, 31/01/25	39 542	0,01
				200 000 USD	Gol Finance SA, 8.000%, 30/06/26	71 126	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Luxembourg (suite)				Luxembourg (suite)			
250 000 USD	Herens Holdco Sarl, 4.750%, 15/05/28	205 086	0,04	120 000 USD	Rede D'or Finance Sarl, 4.500%, 22/01/30	108 749	0,02
100 000 EUR	Herens Midco Sarl, 5.250%, 15/05/29	66 276	0,01	200 000 EUR	Rossini Sarl, 6.750%, 30/10/25	220 930	0,04
100 000 USD	Hidrovias International Finance SARL, 4.950%, 08/02/31	79 050	0,01	70 000 USD	Rumo Luxembourg Sarl, 5.250%, 10/01/28	67 386	0,01
100 000 EUR	HSE Finance Sarl, 5.625%, 15/10/26	59 878	0,01	160 000 USD	Rumo Luxembourg Sarl, 4.200%, 18/01/32	136 200	0,03
100 000 EUR	InPost SA, 2.250%, 15/07/27	102 289	0,02	100 000 EUR	Samsonite Finco Sarl, 3.500%, 15/05/26	108 084	0,02
855 000 USD	Intelsat Jackson Holdings SA, 6.500%, 15/03/30	814 544	0,16	100 000 EUR	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl, 5.625%, 15/12/26	104 058	0,02
110 000 USD	ION Trading Technologies Sarl, 5.750%, 15/05/28	97 034	0,02	100 000 EUR	SES SA, 2.875%, perpetual	100 265	0,02
100 000 EUR	Kleopatra Finco Sarl, 4.250%, 01/03/26	90 756	0,02	200 000 EUR	SIG Combibloc PurchaseCo Sarl, 2.125%, 18/06/25	216 173	0,04
100 000 EUR	Kleopatra Holdings 2 SCA, 6.500%, 01/09/26	57 442	0,01	100 000 EUR	Signa Development Finance SCS, 5.500%, 23/07/26	7 622	0,00
112 486 EUR	LHMC Finco 2 Sarl, 7.250%, 02/10/25	123 326	0,02	200 000 USD	Simpar Europe SA, 5.200%, 26/01/31	173 250	0,03
100 000 EUR	LOARRE INVESTMENTS SARL, 6.500%, 15/05/29	108 600	0,02	206 000 USD	SK Invictus Intermediate II Sarl, 5.000%, perpetual	178 705	0,03
100 000 EUR	LUNE HOLDINGS SARL, 5.625%, 15/11/28	89 574	0,02	100 000 USD	Stena International SA, 6.125%, 01/02/25	99 421	0,02
104 375 EUR	Mangrove Luxco III Sarl, 7.775%, 09/10/25	106 923	0,02	200 000 EUR	Stena International SA, 7.250%, 15/02/28	233 832	0,04
200 000 EUR	Matterhorn Telecom SA, 3.125%, 15/09/26	213 472	0,04	90 105 EUR	Summer BC Holdco A Sarl, 9.250%, 31/10/27	88 586	0,02
150 000 EUR	Matterhorn Telecom SA, 4.000%, 15/11/27	162 782	0,03	200 000 EUR	Summer BC Holdco B SARL, 5.750%, 31/10/26	211 460	0,04
724 689 USD	MC Brazil Downstream Trading SARL, 7.250%, 30/06/31	567 975	0,11	250 000 USD	Telecom Italia Capital SA, 6.375%, 15/11/33	244 437	0,05
180 000 USD	Millicom International Cellular SA, 6.250%, 25/03/29	170 609	0,03	290 000 USD	Telecom Italia Capital SA, 6.000%, 30/09/34	275 397	0,05
200 000 USD	Millicom International Cellular SA, 4.500%, 27/04/31	166 130	0,03	300 000 USD	Telecom Italia Capital SA, 7.200%, 18/07/36	301 663	0,06
750 000 USD	Minerva Luxembourg SA, 4.375%, perpetual	618 269	0,12	350 000 USD	Telecom Italia Capital SA, 7.721%, 04/06/38	356 206	0,07
100 000 EUR	Monitchem HoldCo 3 SA, 8.750%, 01/05/28	112 516	0,02	300 000 EUR	Telecom Italia Finance SA, 7.750%, 24/01/33	385 945	0,07
200 000 EUR	Motion Finco Sarl, 7.375%, 15/06/30	225 367	0,04	100 000 EUR	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl, 3.500%, 01/03/28	105 129	0,02
140 000 USD	Movida Europe SA, 5.250%, 08/02/31	121 603	0,02	200 000 USD	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl, 5.500%, 01/03/28	187 000	0,04
80 000 USD	Natura &Co Luxembourg Holdings Sarl, 6.000%, 19/04/29	76 635	0,01	30 000 USD	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc, 5.375%, 01/09/25	25 972	0,00
100 000 USD	Nexa Resources SA, 5.375%, 04/05/27	97 620	0,02	155 000 USD	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc, 5.125%, 01/04/29	63 161	0,01
200 000 USD	Petrorio Luxembourg Trading Sarl, 6.125%, 09/06/26	196 468	0,04	100 000 USD	Ultrapar International SA, 5.250%, 06/06/29	94 090	0,02
100 000 EUR	Picard Bondco SA, 5.375%, 01/07/27	103 285	0,02	100 000 USD	Unigel Luxembourg SA, 8.750%, 01/10/26	27 270	0,00
100 000 EUR	PLT VII Finance Sarl, 4.625%, 05/01/26	109 636	0,02	312 000 USD	Usiminas International Sarl, 5.875%, 18/07/26	304 820	0,06
200 000 USD	Puma International Financing SA, 5.000%, 24/01/26	190 200	0,04				
100 000 USD	Rede D'or Finance Sarl, 4.950%, 17/01/28	94 875	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Luxembourg (suite)				Mexique (suite)			
150 000	EUR Vivion Investments Sarl, 6.500%, 31/08/28	128 664	0,02	200 000	USD Grupo Aeromexico SAB de CV, 8.500%, 17/03/27	193 046	0,04
150 000	EUR Vivion Investments Sarl, 6.500%, 28/02/29	125 930	0,02	100 000	USD Grupo Axo SAPI de CV, 5.750%, perpetual	92 887	0,02
Luxembourg – Total				75 000	USD Grupo KUO SAB De CV, 5.750%, 07/07/27	66 507	0,01
Malte				150 000	USD Metalsa Sapi De Cv, 3.750%, 04/05/31	124 149	0,02
320 000	USD VistaJet Malta Finance PLC / Vista Management Holding Inc, 6.375%, 01/02/30	223 300	0,04	100 000	EUR Nemak SAB de CV, 2.250%, 20/07/28	97 758	0,02
Malte – Total				100 000	USD Nemak SAB de CV, 3.625%, 28/06/31	83 040	0,02
Île Maurice				200 000	USD Operadora de Servicios Mega SA de CV Sofom ER, 8.250%, 11/02/25	104 250	0,02
172 620	USD Azure Power Energy Ltd, 3.575%, 19/08/26	152 075	0,03	120 000	USD Total Play Telecomunicaciones SA de CV, 7.500%, 12/11/25	79 404	0,01
450 000	USD CA Magnum Holdings, 5.375%, 31/10/26	418 500	0,08	60 000	USD Total Play Telecomunicaciones SA de CV, 6.375%, 20/09/28	24 403	0,00
200 000	USD Diamond II Ltd, 7.950%, 28/07/26	200 118	0,04	Mexique – Total			
180 000	USD Greenko Power II Ltd, 4.300%, 13/12/28	162 045	0,03	3 076 047 0,59			
250 000	USD Greenko Solar Mauritius Ltd, 5.550%, 29/01/25	243 650	0,04	Pays-Bas			
200 000	USD Greenko Solar Mauritius Ltd, 5.950%, 29/07/26	193 100	0,04	200 000	EUR Abertis Infraestructuras Finance BV, 2.625%, perpetual	201 024	0,04
221 000	USD India Cleantech Energy, 4.700%, 10/08/26	200 557	0,04	300 000	EUR Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.248%, perpetual	317 250	0,06
275 000	USD India Green Power Holdings, 4.000%, 22/02/27	251 281	0,05	200 000	EUR Ashland Services BV, 2.000%, 30/01/28	204 878	0,04
275 000	USD Network i2i Ltd, 5.650%, perpetual	270 993	0,05	150 000	USD Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV, 7.250%, 15/02/31	157 875	0,03
Île Maurice – Total				200 000	EUR Boels Topholding BV, 6.250%, 15/02/29	230 338	0,04
Mexique				300 000	USD Braskem Netherlands Finance BV, 8.500%, 23/01/81	258 000	0,05
140 000	USD Alsea SAB de CV, 7.750%, 14/12/26	142 963	0,03	300 000	EUR Citycon Treasury BV, 1.625%, 12/03/28	264 223	0,05
350 000	USD Braskem Idesa SAPI, 7.450%, 15/11/29	220 064	0,04	100 000	EUR Compact Bidco BV, 5.750%, 01/05/26	51 808	0,01
250 000	USD Braskem Idesa SAPI, 6.990%, 20/02/32	141 250	0,03	100 000	USD Coruripe Netherlands BV, 10.000%, 10/02/27	76 750	0,01
425 000	USD Cemex Sab De CV, 5.125%, perpetual	403 133	0,08	200 000	EUR Darling Global Finance BV, 3.625%, 15/05/26	217 974	0,04
100 000	EUR Cemex SAB de CV, 3.125%, 19/03/26	108 068	0,02	300 000	EUR Dufry One Bv, 3.375%, 15/04/28	315 654	0,06
200 000	USD Cemex SAB de CV, 5.450%, 19/11/29	197 202	0,04	100 000	EUR Dufry One BV, 2.000%, 15/02/27	103 187	0,02
100 000	USD Cemex SAB de CV, 5.200%, 17/09/30	96 332	0,02	125 000	USD Embraer Netherlands Finance BV, 5.400%, 01/02/27	124 199	0,02
300 000	USD Cemex SAB de CV, 3.875%, 11/07/31	268 326	0,05	200 000	USD Embraer Netherlands Finance BV, 6.950%, 17/01/28	206 670	0,04
300 000	USD Cemex SAB de CV, 9.125%, perpetual	319 438	0,06	250 000	USD Embraer Netherlands Finance BV, 7.000%, 28/07/30	262 227	0,05
200 000	USD CIBANCO SA Institucion de Banca Multiple Trust CIB/3332, 4.375%, 22/07/31	151 492	0,03	200 000	EUR Energizer Gamma Acquisition BV, 3.500%, 30/06/29	189 515	0,04
75 000	USD Cydsa SAB de CV, 6.250%, 04/10/27	72 263	0,01	200 000	EUR Goodyear Europe BV, 2.750%, 15/08/28	204 842	0,04
100 000	USD Electricidad Firme de Mexico Holdings SA de CV, 4.900%, 20/11/26	90 072	0,02	323 750	USD Greenko Dutch BV, 3.850%, 29/03/26	301 120	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Pays-Bas (suite)				Pays-Bas (suite)			
200 000 GBP	GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV, 8.500%, 15/01/31	275 357	0,05	200 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 5.500%, 10/06/51	168 662	0,03
200 000 EUR	House of HR Group BV, 9.000%, 03/11/29	228 970	0,04	480 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 6.850%, 05/06/15	452 189	0,09
250 000 USD	IHS Netherlands Holdco BV, 8.000%, 18/09/27	222 485	0,04	100 000 EUR	Phoenix PIB Dutch Finance BV, 2.375%, 05/08/25	107 322	0,02
200 000 EUR	IPD 3 BV, 8.000%, 15/06/28	235 487	0,04	100 000 EUR	PPF Telecom Group BV, 2.125%, 31/01/25	107 995	0,02
100 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 2.000%, perpetual	107 107	0,02	200 000 EUR	PPF Telecom Group BV, 3.125%, 27/03/26	216 497	0,04
200 000 EUR	Koninklijke KPN NV, 6.000%, perpetual	228 442	0,04	100 000 EUR	PPF Telecom Group BV, 3.250%, 29/09/27	107 120	0,02
100 000 EUR	MAS Securities BV, 4.250%, 19/05/26	98 203	0,02	100 000 EUR	Q-Park Holding I BV, 1.500%, 01/03/25	108 008	0,02
100 000 EUR	Maxeda DIY Holding BV, 5.875%, 01/10/26	82 915	0,02	150 000 EUR	Q-Park Holding I BV, 2.000%, 01/03/27	152 692	0,03
161 272 USD	MV24 Capital BV, 6.748%, 01/06/34	150 905	0,03	300 000 EUR	Saipem Finance International BV, 3.375%, 15/07/26	322 642	0,06
100 000 EUR	Naturgy Finance BV, 2.374%, perpetual	100 523	0,02	100 000 EUR	Saipem Finance International BV, 3.125%, 31/03/28	104 154	0,02
100 000 EUR	Nobian Finance BV, 3.625%, 15/07/26	105 770	0,02	315 731 EUR	Selecta Group BV, 10.000%, 01/07/26	281 173	0,05
100 000 EUR	OI European Group BV, 2.875%, 15/02/25	109 062	0,02	125 000 USD	Sensata Technologies BV, 5.000%, 01/10/25	125 190	0,02
200 000 EUR	OI European Group BV, 6.250%, 15/05/28	231 093	0,04	200 000 EUR	Sigma Holdco BV, 5.750%, 15/05/26	197 310	0,04
110 000 USD	OI European Group BV, 4.750%, perpetual	102 883	0,02	145 000 USD	Sigma Holdco BV, 7.875%, 15/05/26	130 500	0,02
100 000 GBP	Petrobras Global Finance BV, 6.250%, 14/12/26	127 343	0,02	126 870 EUR	Summer BidCo BV, 9.000%, 15/11/25	139 010	0,03
165 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 7.375%, 17/01/27	173 914	0,03	200 000 EUR	Telefonica Europe BV, 2.376%, perpetual	191 685	0,04
400 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 5.999%, 27/01/28	406 811	0,08	100 000 EUR	Telefonica Europe BV, 2.502%, perpetual	101 681	0,02
100 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 5.750%, 01/02/29	100 796	0,02	200 000 EUR	Telefonica Europe BV, 2.875%, perpetual	205 465	0,04
100 000 GBP	Petrobras Global Finance BV, 5.375%, 01/10/29	118 615	0,02	200 000 EUR	Telefonica Europe BV, 2.880%, perpetual	200 770	0,04
100 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 5.093%, 15/01/30	97 415	0,02	100 000 EUR	Telefonica Europe BV, 3.875%, perpetual	106 796	0,02
275 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 5.600%, 03/01/31	273 896	0,05	200 000 EUR	Telefonica Europe BV, 4.375%, perpetual	219 096	0,04
500 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 6.500%, 03/07/33	507 466	0,10	300 000 EUR	Telefonica Europe BV, 6.135%, perpetual	340 508	0,07
100 000 GBP	Petrobras Global Finance BV, 6.625%, 16/01/34	121 137	0,02	300 000 EUR	Telefonica Europe BV, 6.750%, perpetual	353 479	0,07
325 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 6.875%, 20/01/40	333 026	0,06	300 000 EUR	Telefonica Europe BV, 7.125%, perpetual	357 413	0,07
200 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 6.750%, 27/01/41	199 987	0,04	250 000 EUR	TenneT Holding BV, 2.374%, perpetual	267 544	0,05
100 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 5.625%, 20/05/43	90 313	0,02	100 000 EUR	Titan Holdings II BV, 5.125%, 15/07/29	94 448	0,02
200 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 7.250%, 17/03/44	208 909	0,04	200 000 EUR	TMNL Holding BV, 3.750%, 15/01/29	209 055	0,04
200 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 6.900%, 19/03/49	198 527	0,04	100 000 EUR	Trivium Packaging Finance BV, 3.750%, 15/08/26	106 599	0,02
150 000 USD	Petrobras Global Finance BV, 6.750%, 03/06/50	146 905	0,03	350 000 USD	Trivium Packaging Finance BV, 5.500%, 15/08/26	343 388	0,07

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				
Pays-Bas (suite)				Norvège				
175 000 USD	Trivium Packaging Finance BV, 8.500%, 15/08/27	171 645	0,03	200 000 EUR	Adevinta ASA, 3.000%, 15/11/27	219 616	0,04	
100 000 EUR	United Group BV, 3.125%, 15/02/26	105 755	0,02	100 000 EUR	ADEVINTAASA, 2.625%, 15/11/25	109 318	0,02	
75 000 EUR	United Group BV, 4.000%, 15/11/27	78 117	0,01	200 000 EUR	Var Energi ASA, 7.862%, 15/11/83	234 966	0,05	
150 000 EUR	United Group BV, 3.625%, 15/02/28	152 895	0,03	Norvège – Total			563 900	0,11
150 000 EUR	United Group BV, 4.625%, 15/08/28	156 584	0,03	Oman				
100 000 EUR	United Group BV, 5.250%, 01/02/30	104 389	0,02	200 000 USD	Bank Muscat SAOG, 4.750%, 17/03/26	195 800	0,04	
440 000 USD	UPC Broadband Finco BV, 4.875%, 15/07/31	387 248	0,07	200 000 USD	Mazoon Assets Co SAOC, 5.200%, 08/11/27	194 257	0,03	
100 000 USD	UPC Holding BV, 5.500%, 15/01/28	94 273	0,02	200 000 USD	Oq SAoc, 5.125%, perpetual	197 495	0,04	
100 000 EUR	UPC Holding BV, 3.875%, 15/06/29	102 099	0,02	Oman – Total			587 552	0,11
100 000 EUR	Versuni Group BV, 3.125%, 15/06/28	96 641	0,02	Panama				
200 000 USD	VTR Finance NV, 6.375%, 15/07/28	51 862	0,01	64 000 USD	Banistmo SA, 4.250%, 31/07/27	57 925	0,01	
100 000 EUR	VZ Secured Financing BV, 3.500%, 15/01/32	97 278	0,02	200 000 EUR	Carnival Corp, 7.625%, 01/03/26	224 023	0,04	
400 000 USD	VZ Secured Financing BV, 5.000%, 15/01/32	340 396	0,06	283 000 USD	Carnival Corp, 7.625%, 01/03/26	288 127	0,06	
200 000 EUR	VZ Vendor Financing II BV, 2.875%, 15/01/29	193 590	0,04	955 000 USD	Carnival Corp, 5.750%, 01/03/27	932 556	0,18	
200 000 EUR	Wintershall Dea Finance 2 BV, 2.499%, perpetual	199 942	0,04	572 000 USD	Carnival Corp, 4.000%, 01/08/28	531 688	0,10	
200 000 EUR	Wintershall Dea Finance 2 BV, 3.000%, perpetual	192 209	0,04	508 000 USD	Carnival Corp, 6.000%, 01/05/29	488 648	0,09	
100 000 EUR	Wizz Air Finance Co BV, 1.000%, 19/01/26	101 382	0,02	75 000 USD	Carnival Corp, 7.000%, 15/08/29	78 348	0,02	
100 000 EUR	Wp/ap Telecom Holdings III BV, 5.500%, 15/01/30	100 536	0,02	275 000 USD	Carnival Corp, 10.500%, 01/06/30	300 798	0,06	
200 000 EUR	Zf Europe Finance Bv, 2.500%, 23/10/27	206 293	0,04	80 000 USD	TeleComunicaciones Digitales SA, 4.500%, 30/01/30	68 916	0,01	
400 000 EUR	ZF Europe Finance BV, 6.125%, 13/03/29	469 052	0,09	Panama – Total			2 971 029	0,57
150 000 USD	Ziggo Bond Co BV, 6.000%, 15/01/27	145 989	0,03	Paraguay				
100 000 EUR	Ziggo Bond Co BV, 3.375%, 28/02/30	93 073	0,02	150 000 USD	Banco Continental SAECA, 2.750%, 10/12/25	140 204	0,03	
100 000 USD	Ziggo Bond Co BV, 5.125%, 28/02/30	83 614	0,02	100 000 USD	Frigorifico Concepcion SA, 7.700%, 21/07/28	84 425	0,01	
225 000 EUR	Ziggo BV, 2.875%, 15/01/30	220 806	0,04	200 000 USD	Telefonica Celular del Paraguay SA, 5.875%, 15/04/27	194 659	0,04	
280 000 USD	Ziggo BV, 4.875%, 15/01/30	249 657	0,05	Paraguay – Total			419 288	0,08
Pays-Bas – Total				Pérou				
		19 085 512	3,64	50 000 USD	Banco BBVA Peru SA, 5.250%, 22/09/29	49 192	0,01	
Nigeria				150 000 USD	Banco Internacional del Peru SAA Interbank, 4.000%, 08/07/30	143 250	0,03	
70 000 USD	Access Bank PLC, 6.125%, perpetual	62 559	0,01	50 000 USD	Camposol SA, 6.000%, 03/02/27	34 591	0,01	
200 000 USD	Fidelity Bank PLC, 7.625%, 28/10/26	181 000	0,03	250 000 USD	Cia de Minas Buenaventura SAA, 5.500%, 23/07/26	238 664	0,04	
325 000 USD	SEPLAT Energy PLC, 7.750%, 01/04/26	297 473	0,06	25 000 USD	InRetail Shopping Malls, 5.750%, 03/04/28	24 387	0,00	
Nigeria – Total				100 000 USD	Minsur SA, 4.500%, 28/10/31	88 389	0,02	
		541 032	0,10	250 000 USD	Orazul Energy Peru SA, 5.625%, 28/04/27	235 325	0,04	
				250 000 USD	Peru LNG Srl, 5.375%, 22/03/30	206 850	0,04	
				400 000 USD	Petroleos del Peru SA, 4.750%, 19/06/32	285 657	0,05	
				750 000 USD	Petroleos del Peru SA, 5.625%, 19/06/47	459 375	0,09	
				52 000 USD	Volcan Cia Minera SAA, 4.375%, 11/02/26	32 338	0,01	
				Pérou – Total			1 798 018	0,34

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Philippines				Afrique du Sud			
200 000	USD Rizal Commercial Banking Corp, 6.500%, 31/12/99	187 592	0,04	200 000	USD Bidvest Group UK PLC, 3.625%, 23/09/26	185 000	0,03
Philippines – Total				250 000 USD Transnet SOC Ltd, 8.250%, 06/02/28			
Pologne				Afrique du Sud – Total			
100 000	EUR Bank Millennium SA, 9.875%, 18/09/27	116 231	0,02	436 575 0,08			
300 000	EUR mBank SA, 8.375%, 11/09/27	348 828	0,06	Espagne			
100 000	EUR mBank SA, 0.966%, 21/09/27	95 441	0,02	100 000	EUR Abanca Corp Bancaria SA, 4.625%, 07/04/30	108 516	0,02
150 000	EUR Synthos SA, 2.500%, 07/06/28	140 344	0,03	100 000	EUR Abanca Corp Bancaria SA, 8.375%, 23/09/33	118 750	0,02
Pologne – Total				200 000 EUR ACS Actividades de Construccion y Servicios SA, 1.375%, 17/06/25			
Portugal				100 000 EUR Aedas Homes Opco Slu, 4.000%, 15/08/26			
100 000	EUR Banco Comercial Portugues SA, 3.871%, 27/03/30	107 041	0,02	206 250	USD AI Candelaria Spain SA, 7.500%, 15/12/28	195 422	0,04
100 000	EUR Banco Comercial Portugues SA, 4.000%, 17/05/32	101 445	0,02	400 000	USD AI Candelaria Spain SA, 5.750%, perpetual	310 140	0,06
200 000	EUR Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL, 8.375%, 04/07/27	229 043	0,04	100 000	EUR Almirall SA, 2.125%, 30/09/26	106 094	0,02
200 000	EUR EDP - Energias de Portugal SA, 1.700%, 20/07/80	210 957	0,04	100 000	EUR Banco de Credito Social Cooperativo SA, 1.750%, 09/03/28	97 209	0,02
100 000	EUR EDP - Energias de Portugal SA, 1.875%, 02/08/81	102 732	0,02	200 000	EUR Banco de Credito Social Cooperativo SA, 7.500%, 14/09/29	231 396	0,04
100 000	EUR EDP - Energias de Portugal SA, 1.500%, 14/03/82	99 225	0,02	100 000	EUR Banco de Credito Social Cooperativo SA, 5.250%, 27/11/31	101 858	0,02
200 000	EUR EDP - Energias de Portugal SA, 1.875%, 14/03/82	185 904	0,03	200 000	EUR BanCo de Credito Social Cooperativo SA, 8.000%, 22/09/26	229 725	0,04
400 000	EUR EDP - Energias de Portugal SA, 5.943%, 23/04/83	458 456	0,09	100 000	EUR Banco de Sabadell SA, 1.125%, 27/03/25	106 938	0,02
200 000	EUR Novo Banco SA, 9.875%, 01/12/33	244 128	0,05	200 000	EUR Banco de Sabadell SA, 2.625%, 24/03/26	216 497	0,04
Portugal – Total				200 000 EUR Banco de Sabadell SA, 0.875%, 16/06/28			
1 738 931 0,33				200 000 EUR Banco de Sabadell SA, 5.250%, 07/02/29			
Roumanie				200 000 EUR Banco de Sabadell SA, 5.500%, 08/09/29			
200 000	EUR Banca Transilvania SA, 8.875%, 27/04/27	232 268	0,04	600 000	EUR Banco de Sabadell SA, 6.000%, 16/08/33	670 008	0,13
100 000	EUR Banca Transilvania SA, 7.250%, 07/12/28	113 238	0,02	600 000	EUR Cellnex Finance Co SA, 2.250%, 12/04/26	643 134	0,12
100 000	EUR RCS & RDS SA, 2.500%, 05/02/25	107 841	0,02	200 000	EUR Cellnex Finance Co SA, 0.750%, 15/11/26	204 434	0,04
100 000	EUR RCS & RDS SA, 3.250%, 05/02/28	98 316	0,02	200 000	EUR Cellnex Finance Co SA, 1.000%, 15/09/27	202 196	0,04
Roumanie – Total				300 000 EUR Cellnex Finance Co SA, 1.500%, 08/06/28			
551 663 0,10				200 000 EUR Cellnex Finance Co SA, 1.250%, 15/01/29			
Singapour				100 000 USD Cellnex Finance Co SA, 3.875%, 07/07/41			
200 000	USD Continuum Energy Aura Pte Ltd, 9.500%, 24/02/27	203 270	0,04	300 000	EUR Cellnex Telecom SA, 2.875%, 18/04/25	328 192	0,06
147 056	USD Continuum Energy Levanter Pte Ltd, 4.500%, 09/02/27	137 979	0,03				
50 000	USD Global Prime Capital Pte Ltd, 5.950%, 23/01/25	49 875	0,01				
200 000	USD GLP Pte Ltd, 4.500%, perpetual	63 242	0,01				
200 000	USD Medco Bell Pte Ltd, 6.375%, 30/01/27	190 404	0,04				
200 000	USD Medco Laurel Tree Pte Ltd, 6.950%, perpetual	189 179	0,03				
Singapour – Total							
833 949 0,16							

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Espagne (suite)				Suède (suite)			
300 000	EUR Cellnex Telecom SA, 1.875%, 26/06/29	302 054	0,06	100 000	EUR Fastighets AB Balder, 2.873%, 02/06/81	83 125	0,02
200 000	EUR Cellnex Telecom SA, 1.750%, 23/10/30	193 418	0,04	200 000	EUR Heimstaden AB, 4.250%, 09/03/26	102 964	0,02
100 000	EUR eDreams ODIGEO SA, 5.500%, 15/07/27	110 001	0,02	100 000	EUR Heimstaden AB, 6.750%, perpetual	22 093	0,00
250 000	USD EnfraGen Energia Sur SA / EnfraGen Spain SA / Prime Energia SpA, 5.375%, 30/12/30	195 020	0,04	200 000	EUR Heimstaden Bostad AB, 3.248%, 31/12/99	112 674	0,02
150 000	EUR Eroski S Coop, 10.625%, 30/04/29	170 357	0,03	200 000	EUR Heimstaden Bostad AB, 3.625%, perpetual	83 610	0,02
100 000	EUR Food Service Project SA, 5.500%, 21/01/27	110 104	0,02	100 000	EUR Heimstaden Bostad AB, 2.625%, perpetual	37 061	0,01
100 000	EUR Foodco Bondco SA, 6.250%, 15/05/26	46 395	0,01	100 000	EUR Heimstaden Bostad AB, 3.000%, perpetual	36 809	0,01
100 000	EUR Gestamp Automocion SA, 3.250%, 30/04/26	108 293	0,02	200 000	EUR Intrum AB, 4.875%, 15/08/25	206 017	0,04
100 000	EUR Green Bidco SA, 10.250%, 15/07/28	96 602	0,02	200 000	EUR Intrum AB, 3.500%, 15/07/26	186 686	0,04
200 000	EUR Grifols SA, 1.625%, 15/02/25	215 696	0,04	200 000	EUR Intrum AB, 3.000%, 15/09/27	167 885	0,03
100 000	EUR Grifols SA, 3.200%, 01/05/25	107 828	0,02	200 000	EUR Intrum AB, 9.250%, 15/03/28	201 342	0,04
200 000	EUR Grifols SA, 2.250%, 15/11/27	207 553	0,04	90 000	EUR Preem Holdings AB, 12.000%, 30/06/27	107 372	0,02
425 000	EUR Grifols SA, 3.875%, 15/10/28	428 360	0,08	100 000	EUR Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 1.750%, 14/01/25	95 002	0,02
120 000	USD Grifols SA, 4.750%, 15/10/28	108 824	0,02	200 000	EUR Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2.375%, 04/09/26	158 046	0,03
100 000	EUR Grupo Antolin-Irausa SA, 3.500%, 30/04/28	83 785	0,02	200 000	EUR Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2.250%, perpetual	148 005	0,03
100 000	EUR Ibercaja Banco SA, 2.750%, 23/07/30	105 360	0,02	100 000	EUR Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2.624%, perpetual	16 919	0,00
200 000	EUR International Consolidated Airlines Group SA, 1.500%, 04/07/27	204 360	0,04	100 000	EUR Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2.625%, perpetual	16 804	0,00
100 000	EUR International Consolidated Airlines Group SA, 3.750%, 25/03/29	106 875	0,02	100 000	EUR Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2.875%, perpetual	17 122	0,00
100 000	EUR Kaixo Bondco Telecom SA, 5.125%, 30/09/29	103 009	0,02	150 000	EUR Verisure Holding AB, 3.875%, 15/07/26	162 400	0,03
525 000	EUR Lorca Telecom Bondco SA, 4.000%, 18/09/27	565 437	0,11	300 000	EUR Verisure Holding AB, 3.250%, 15/02/27	317 486	0,06
100 000	EUR NH Hotel Group SA, 4.000%, 02/07/26	109 084	0,02	200 000	EUR Verisure Holding AB, 9.250%, 15/10/27	237 007	0,05
77 521	EUR Ohl Operaciones SA, 9.750%, 31/03/26	78 997	0,02	200 000	EUR Verisure Holding AB, 7.125%, 01/02/28	232 436	0,04
100 000	EUR Unicaja Banco SA, 7.250%, 15/11/27	116 890	0,02	200 000	EUR Verisure Midholding AB, 5.250%, 15/02/29	210 436	0,04
100 000	EUR Unicaja Banco SA, 6.500%, 11/09/28	114 628	0,02	200 000	EUR Volvo Car AB, 2.000%, 24/01/25	215 683	0,04
100 000	EUR Unicaja Banco SA, 3.125%, 19/07/32	97 639	0,02	100 000	EUR Volvo Car AB, 4.250%, 31/05/28	111 291	0,02
200 000	EUR Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 5.250%, 01/04/26	210 988	0,04	100 000	EUR VOLVO CAR AB, 2.500%, 07/10/27	104 389	0,02
Espagne – Total				Suède – Total			
		9 720 840	1,86			3 962 152	0,76
Suède				Thaïlande			
100 000	EUR Akelius Residential Property AB, 2.249%, 17/05/81	92 614	0,02	250 000	USD Bangkok Bank PCL, 3.733%, 25/09/34	221 647	0,04
300 000	EUR Castellum AB, 3.125%, perpetual	250 146	0,05	200 000	USD Kasikornbank PCL, 3.343%, 02/10/31	183 836	0,04
100 000	EUR Dometic Group AB, 3.000%, 08/05/26	108 597	0,02	Thaïlande – Total			
125 000	EUR Dometic Group AB, 2.000%, 29/09/28	120 131	0,02			405 483	0,08

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				
Trinité-et-Tobago				Émirats arabes unis				
100 000	USD Coca-Cola Icecek AS, 4.500%, perpetual	91 662	0,02	200 000	USD Emirates NBD Bank PJSC, 6.125%, perpetual	198 536	0,04	
200 000	USD Heritage Petroleum Co Ltd, 9.000%, 12/08/29	210 100	0,04	200 000	USD Kuwait Projects Co SPC Ltd, 4.500%, 23/02/27	175 316	0,03	
100 000	USD National Gas Co of Trinidad & Tobago Ltd, 6.050%, 15/01/36	91 000	0,02	120 000	USD Oztel Holdings SPC Ltd, 6.625%, 24/04/28	125 250	0,02	
25 000	USD Telecommunications Services of Trinidad & Tobago Ltd, 8.875%, 18/10/29	22 750	0,00	450 000	USD Shelf Drilling Holdings Ltd, 9.625%, 15/04/29	440 354	0,09	
200 000	USD Trinidad Generation UnLtd, 5.250%, 04/11/27	196 693	0,04	Émirats arabes unis – Total			939 456	0,18
Trinité-et-Tobago – Total				Royaume-Uni				
612 205				0,12				
Turquie				200 000 USD Allwyn Entertainment Financing UK PLC, 7.875%, 30/04/29				
200 000	USD Akbank TAS, 6.800%, 06/02/26	200 500	0,04	200 000	EUR Allwyn Entertainment Financing UK PLC, 7.250%, 30/04/30	232 067	0,04	
200 000	USD Akbank TAS, 6.800%, perpetual	197 273	0,04	100 000	USD Atlantica Sustainable Infrastructure PLC, 4.125%, 15/06/28	93 719	0,02	
200 000	USD Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS, 3.375%, 29/06/28	170 494	0,03	360 000	USD Avianca MidCo 2 PLC, 9.000%, 01/12/28	316 181	0,06	
100 000	EUR Arcelik AS, 3.000%, 27/05/26	105 459	0,02	100 000	EUR BCP V Modular Services Finance II PLC, 4.750%, 30/11/28	102 041	0,02	
200 000	USD Aydem Yenilenebilir Enerji AS, 7.750%, 02/02/27	181 596	0,03	100 000	GBP BCP V Modular Services Finance II PLC, 6.125%, 30/11/28	113 776	0,02	
130 000	USD KOC Holding AS, 6.500%, 11/03/25	129 288	0,02	200 000	EUR BCP V Modular Services Finance PLC, 6.750%, 30/11/29	181 127	0,03	
200 000	USD Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS, 8.250%, 15/11/28	208 256	0,04	350 000	GBP Bellis Acquisition Co PLC, 3.250%, 16/02/26	413 123	0,08	
200 000	USD QNB Finansbank AS, 10.750%, 15/11/33	215 000	0,04	250 000	GBP Bellis Acquisition Co PLC, 4.500%, 16/02/26	301 012	0,06	
200 000	USD TC Ziraat Bankası AS, 5.375%, 02/03/26	192 599	0,04	100 000	GBP Bellis Finco PLC, 4.000%, 16/02/27	110 351	0,02	
200 000	USD TC Ziraat Bankası AS, 9.500%, 01/08/26	210 333	0,04	200 000	GBP Boparan Finance PLC, 7.625%, 30/11/25	225 640	0,04	
200 000	USD Turkcell İletişim Hizmetleri AS, 5.750%, 15/10/25	196 187	0,04	100 000	GBP Bracken MidCo1 PLC, 6.750%, 01/11/27	114 796	0,02	
200 000	USD Türkiye İş Bankası AS, 7.750%, 22/01/30	200 500	0,04	100 000	EUR British Telecommunications PLC, 1.874%, 18/08/80	105 218	0,02	
25 000	USD Türkiye Sınai Kalkınma Bankası AS, 5.875%, 14/01/26	24 512	0,00	100 000	USD British Telecommunications PLC, 4.250%, 23/11/81	92 162	0,02	
300 000	USD Türkiye Sise ve Cam Fabrikaları AS, 6.950%, 14/03/26	297 810	0,06	120 000	USD British Telecommunications PLC, 4.875%, 23/11/81	102 622	0,02	
425 000	USD Türkiye Vakıflar Bankası TAO, 6.500%, 08/01/26	420 656	0,08	200 000	GBP British Telecommunications PLC, 8.375%, 20/12/83	268 814	0,05	
250 000	USD Türkiye Vakıflar Bankası TAO, 5.250%, perpetual	246 350	0,05	50 000	GBP Burford Capital PLC, 5.000%, 01/12/26	59 297	0,01	
100 000	USD Ülker Bisküvi Sanayi AS, 6.950%, 30/10/25	97 892	0,02	100 000	EUR Canary Wharf Group Investment Holdings PLC, 1.750%, 07/04/26	88 742	0,02	
225 000	USD Yapı ve Kredi Bankası AS, 7.875%, 22/01/31	227 925	0,04	100 000	GBP Canary Wharf Group Investment Holdings PLC, 3.375%, 23/04/28	85 435	0,02	
Turquie – Total				200 000 EUR Carnival PLC, 1.000%, 28/10/29				
3 522 630				0,67				
				100 000 GBP Castle UK Finco PLC, 7.000%, 15/05/29				
				200 000 GBP Centrica PLC, 5.250%, 10/04/75				
				100 000 GBP Constellation Automotive Financing PLC, 4.875%, 15/07/27				
				100 000 GBP Co-operative Bank Holdings Ltd, 9.500%, 24/05/28				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
100 000 GBP	Co-operative Bank Holdings Ltd, 11.750%, 22/05/34	142 548	0,03	200 000 EUR	International Game Technology PLC, 3.500%, 15/06/26	219 160	0,04
100 000 GBP	Co-operative Group Holdings 2011 Ltd, 7.500%, 08/07/26	125 205	0,02	231 000 USD	International Game Technology PLC, 6.250%, 15/01/27	234 417	0,04
50 000 GBP	Co-Operative Group Ltd, 11.000%, 22/12/25	66 931	0,01	100 000 EUR	International Game Technology PLC, 2.375%, 15/04/28	102 456	0,02
200 000 GBP	Deuce Finco Plc, 5.500%, 15/06/27	237 189	0,05	100 000 USD	International Game Technology PLC, 5.250%, 15/01/29	98 038	0,02
100 000 EUR	Drax Finco PLC, 2.625%, 01/11/25	106 461	0,02	100 000 EUR	International Personal Finance PLC, 9.750%, 12/11/25	106 555	0,02
300 000 USD	Drax Finco PLC, 6.625%, 01/11/25	294 612	0,06	100 000 GBP	Iron Mountain UK PLC, 3.875%, 15/11/25	122 417	0,02
200 000 EUR	EC Finance PLC, 3.000%, 15/10/26	212 921	0,04	350 000 USD	Ithaca Energy North Sea PLC, 9.000%, 15/07/26	346 245	0,07
100 000 EUR	eG Global Finance PLC, 11.000%, 30/11/28	117 369	0,02	200 000 USD	Jaguar Land Rover Automotive PLC, 7.750%, 15/10/25	202 230	0,04
350 000 USD	eG Global Finance PLC, 12.000%, 30/11/28	372 760	0,07	200 000 EUR	Jaguar Land Rover Automotive PLC, 4.500%, 15/01/26	220 930	0,04
200 000 USD	Endeavour Mining PLC, 5.000%, 14/10/26	183 464	0,04	200 000 EUR	Jaguar Land Rover Automotive PLC, 6.875%, 15/11/26	235 423	0,05
100 000 USD	Energean PLC, 6.500%, perpetual	90 760	0,02	197 000 USD	Jaguar Land Rover Automotive PLC, 4.500%, 01/10/27	185 859	0,04
100 000 USD	EnQuest PLC, 11.625%, 01/11/27	95 290	0,02	200 000 USD	Jaguar Land Rover Automotive PLC, 5.875%, 15/01/28	197 372	0,04
200 000 GBP	Gatwick Airport Finance PLC, 4.375%, 07/04/26	243 805	0,05	100 000 EUR	Jaguar Land Rover Automotive PLC, 4.500%, 15/07/28	107 703	0,02
100 000 GBP	GKN Holdings Ltd, 4.625%, 12/05/32	108 420	0,02	100 000 GBP	Jerrold Finco PLC, 4.875%, 15/01/26	122 572	0,02
200 000 USD	Harbour Energy PLC, 5.500%, 15/10/26	195 500	0,04	200 000 GBP	Jerrold Finco PLC, 5.250%, 15/01/27	236 794	0,05
100 000 GBP	Heathrow Finance PLC, 5.750%, 03/03/25	126 365	0,02	100 000 GBP	KANE BIDCO LTD, 6.500%, 15/02/27	118 110	0,02
100 000 GBP	Heathrow Finance PLC, 3.875%, 01/03/27	117 441	0,02	225 000 USD	Liquid Telecommunications Financing Plc, 5.500%, perpetual	129 769	0,02
200 000 GBP	Iceland Bondco PLC, 10.875%, 15/12/27	265 525	0,05	145 000 USD	Macquarie Airfinance Holdings Ltd, 8.375%, 01/05/28	151 866	0,03
100 000 EUR	INEOS Finance PLC, 2.125%, 15/11/25	106 691	0,02	100 000 GBP	Maison Finco PLC, 6.000%, 31/10/27	109 888	0,02
100 000 EUR	INEOS Finance PLC, 2.875%, 01/05/26	106 908	0,02	275 000 USD	MARB BondCo PLC, 3.950%, 29/01/31	223 321	0,04
300 000 EUR	INEOS Finance PLC, 6.625%, 15/05/28	339 266	0,06	200 000 GBP	Market Bidco Finco PLC, 5.500%, 04/11/27	224 365	0,04
200 000 USD	INEOS Finance PLC, 6.750%, 15/05/28	196 788	0,04	100 000 GBP	Marks & Spencer PLC, 4.500%, 10/07/27	122 832	0,02
100 000 EUR	INEOS FINANCE PLC, 3.375%, 31/03/26	108 103	0,02	80 000 USD	Marks & Spencer PLC, 7.125%, 01/12/37	80 336	0,02
200 000 EUR	INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3.750%, 15/07/26	212 636	0,04	200 000 USD	Mclaren Finance PLC, 7.500%, 01/08/26	171 512	0,03
200 000 EUR	INEOS Quattro Finance 2 Plc, 2.500%, 15/01/26	213 452	0,04	125 000 USD	Merlin Entertainments Ltd, 5.750%, 15/06/26	123 749	0,02
100 000 EUR	INEOS Quattro Finance 2 Plc, 8.500%, 15/03/29	116 410	0,02	100 000 GBP	Mobico Group PLC, 4.250%, perpetual	111 947	0,02
200 000 USD	INEOS Quattro Finance 2 Plc, 9.625%, 15/03/29	213 500	0,04	100 000 EUR	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC, 7.125%, 19/07/26	50 953	0,01
100 000 EUR	International Consolidated Airlines Group SA, 2.750%, 25/03/25	108 303	0,02	200 000 USD	Neptune Energy Bondco PLC, 6.625%, 15/05/25	198 197	0,04
82 000 USD	International Game Technology PLC, 6.500%, 15/02/25	82 093	0,02	100 000 GBP	Newday Bondco PLC, 13.250%, 15/12/26	133 850	0,03
182 000 USD	International Game Technology PLC, 4.125%, 15/04/26	176 889	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				Royaume-Uni (suite)			
200 000 GBP	NGG Finance PLC, 5.625%, 18/06/73	250 955	0,05	470 000 USD	Tullow Oil PLC, 10.250%, perpetual	419 357	0,08
200 000 EUR	NGG Finance PLC, 2.125%, 05/09/82	200 187	0,04	100 000 GBP	Vanquis Banking Group PLC, 8.875%, 13/01/32	111 929	0,02
200 000 EUR	Nomad Foods Bondco PLC, 2.500%, 24/06/28	207 321	0,04	400 000 USD	Vedanta Resources Finance II PLC, 8.950%, 11/03/25	297 500	0,06
100 000 GBP	OCADO GROUP PLC, 3.875%, 08/10/26	108 898	0,02	25 000 USD	Vedanta Resources Finance II PLC, 9.250%, 23/04/26	15 250	0,00
350 000 USD	Odeon Finco PLC, 12.750%, 01/11/27	355 387	0,07	200 000 GBP	Very Group Funding Plc, 6.500%, 01/08/26	221 336	0,04
100 000 EUR	PeopleCert Wisdom Issuer PLC, 5.750%, 15/09/26	108 841	0,02	200 000 EUR	Victoria PLC, 3.625%, 24/08/26	175 971	0,03
270 000 USD	Petrofac Ltd, 9.750%, 15/11/26	141 750	0,03	100 000 EUR	Victoria PLC, 3.750%, 15/03/28	75 669	0,01
100 000 EUR	PEU Fin PLC, 7.250%, 01/07/28	113 595	0,02	100 000 EUR	Virgin Media Finance PLC, 3.750%, 15/07/30	101 075	0,02
100 000 GBP	Pinewood Finance Co Ltd, 3.250%, 30/09/25	123 585	0,02	250 000 USD	Virgin Media Finance PLC, 5.000%, 15/07/30	220 640	0,04
200 000 GBP	Pinewood Finance Co Ltd, 3.625%, 15/11/27	234 096	0,04	200 000 GBP	Virgin Media Secured Finance PLC, 5.000%, 15/04/27	247 857	0,05
200 000 EUR	Pinnacle Bidco PLC, 8.250%, 11/10/28	229 476	0,04	305 000 USD	Virgin Media Secured Finance PLC, 5.500%, 15/05/29	294 644	0,06
200 000 GBP	Pinnacle Bidco PLC, 10.000%, 11/10/28	264 485	0,05	200 000 GBP	Virgin Media Secured Finance PLC, 4.250%, 15/01/30	222 189	0,04
100 000 GBP	Premier Foods Finance PLC, 3.500%, 15/10/26	118 340	0,02	350 000 USD	Virgin Media Secured Finance PLC, 4.500%, 15/08/30	311 605	0,06
200 000 GBP	Punch Finance PLC, 6.125%, 30/06/26	236 794	0,05	250 000 GBP	Vmed O2 UK Financing I PLC, 4.000%, 31/01/29	281 651	0,05
170 000 USD	Rolls-Royce PLC, 3.625%, 14/10/25	163 285	0,03	300 000 EUR	Vmed O2 UK Financing I PLC, 3.250%, 31/01/31	304 055	0,06
200 000 EUR	Rolls-Royce PLC, 4.625%, 16/02/26	224 444	0,04	400 000 USD	Vmed O2 UK Financing I PLC, 4.250%, 31/01/31	349 258	0,07
200 000 GBP	Rolls-Royce PLC, 5.750%, 15/10/27	255 597	0,05	410 000 USD	Vmed O2 UK Financing I PLC, 4.750%, 15/07/31	366 213	0,07
200 000 USD	Rolls-Royce PLC, 5.750%, 15/10/27	200 352	0,04	560 000 USD	Vodafone Group PLC, 7.000%, 04/04/79	577 381	0,11
100 000 EUR	Rolls-Royce PLC, 1.625%, 09/05/28	101 661	0,02	100 000 EUR	Vodafone Group PLC, 2.625%, 27/08/80	104 907	0,02
100 000 GBP	Saga PLC, 5.500%, 15/07/26	101 984	0,02	400 000 EUR	Vodafone Group PLC, 3.000%, 27/08/80	394 993	0,08
200 000 EUR	Sherwood Financing PLC, 4.500%, 15/11/26	203 019	0,04	68 000 USD	Vodafone Group PLC, 3.250%, 04/06/81	62 512	0,01
100 000 EUR	SIG PLC, 5.250%, 30/11/26	99 419	0,02	176 000 USD	Vodafone Group PLC, 4.125%, 04/06/81	151 440	0,03
120 000 USD	Standard Chartered PLC, 7.014%, perpetual	121 670	0,02	400 000 EUR	Vodafone Group PLC, 6.500%, 30/08/84	472 160	0,09
100 000 GBP	Stonegate Pub Co Financing 2019 PLC, 8.000%, 13/07/25	123 656	0,02	200 000 GBP	Vodafone Group PLC, 8.000%, 30/08/86	271 915	0,05
300 000 GBP	Stonegate Pub Co Financing 2019 PLC, 8.250%, 31/07/25	372 879	0,07	410 000 USD	Vodafone Group PLC, 5.125%, perpetual	308 928	0,06
100 000 EUR	Synthomer PLC, 3.875%, 01/07/25	108 888	0,02	100 000 GBP	Voyage Care BondCo PLC, 5.875%, 15/02/27	93 439	0,02
100 000 GBP	TalkTalk Telecom Group Ltd, 3.875%, 20/02/25	99 434	0,02	100 000 GBP	Zenith Finco Plc, 6.500%, 30/06/27	102 813	0,02
125 000 GBP	Thames Water Kemble Finance PLC, 4.625%, 19/05/26	78 677	0,02				
150 000 EUR	TI Automotive Finance PLC, 3.750%, 15/04/29	151 423	0,03	Royaume-Uni – Total		25 795 555	4,92
200 000 EUR	Titan Global Finance PLC, 2.750%, 09/07/27	215 959	0,04				
200 000 USD	Tullow Oil PLC, 7.000%, 01/03/25	184 994	0,04				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis				États-Unis (suite)			
75 000	USD 180 Medical Inc, 3.875%, 15/10/29	67 556	0,01	150 000	USD Ahead DB Holdings LLC, 6.625%, 01/05/28	130 687	0,03
125 000	USD 99 Escrow Issuer Inc, 7.500%, 15/01/26	41 563	0,01	45 000	USD AHP Health Partners Inc, 5.750%, 15/07/29	38 981	0,01
150 000	USD Academy Ltd, 6.000%, 15/11/27	147 286	0,03	121 000	USD Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC, 3.250%, 15/03/26	114 135	0,02
125 000	USD Acadia Healthcare Co Inc, 5.500%, 01/07/28	123 421	0,02	149 000	USD Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC, 7.500%, 15/03/26	151 735	0,03
75 000	USD Acadia Healthcare Co Inc, 5.000%, 15/04/29	71 999	0,01	175 000	USD Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC, 4.625%, 15/01/27	170 169	0,03
171 000	USD Acco Brands Corp, 4.250%, 15/03/29	154 255	0,03	200 000	USD Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC, 5.875%, 15/02/28	200 320	0,04
50 000	USD ACI Worldwide Inc, 5.750%, 15/08/26	49 679	0,01	250 000	USD Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC, 6.500%, 15/02/28	252 573	0,05
95 000	USD ACProducts Holdings Inc, 6.375%, 15/05/29	70 329	0,01	322 000	USD Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC, 3.500%, 15/03/29	292 520	0,06
236 000	USD Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc, 7.000%, 15/11/25	235 414	0,05	446 000	USD Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC, 4.875%, 15/02/30	427 349	0,08
109 000	USD Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc, 10.125%, 01/08/26	113 896	0,02	175 000	USD Allegiant Travel Co, 7.250%, 15/08/27	171 227	0,03
201 000	USD Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc, 4.250%, 15/02/29	181 493	0,03	121 000	USD Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 10.500%, 15/02/28	64 714	0,01
120 000	USD Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc, 6.000%, perpetual	109 038	0,02	103 000	USD Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer, 4.250%, 15/10/27	98 988	0,02
75 000	USD Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 5.000%, 01/05/28	61 125	0,01	469 000	USD Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer, 6.750%, 15/10/27	464 946	0,09
81 000	USD Acushnet Co, 7.375%, 15/10/28	84 506	0,02	415 000	USD Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer, 6.750%, 15/04/28	424 559	0,08
150 000	USD Adams Homes Inc, 9.250%, 15/10/28	152 090	0,03	150 000	USD Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer, 5.875%, 01/11/29	142 121	0,03
145 000	USD AdaptHealth LLC, 6.125%, 01/08/28	125 132	0,02	98 000	USD Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer, 7.000%, 15/01/31	103 048	0,02
93 000	USD AdaptHealth LLC, 4.625%, 01/08/29	71 749	0,01	524 000	USD Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 6.625%, 15/07/26	521 255	0,10
199 000	USD AdaptHealth LLC, 5.125%, 01/03/30	155 327	0,03	390 000	USD Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 9.750%, 15/07/27	382 165	0,07
162 000	USD ADT Security Corp, 4.125%, 01/08/29	149 005	0,03	250 000	USD Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 6.000%, 01/06/29	203 773	0,04
220 000	USD ADT Security Corp, 4.875%, 15/07/32	203 477	0,04	65 000	USD Allison Transmission Inc, 4.750%, 01/10/27	62 799	0,01
90 000	USD Adtalem Global Education Inc, 5.500%, 01/03/28	86 571	0,02	145 000	USD Allison Transmission Inc, 5.875%, 01/06/29	144 468	0,03
125 000	USD Advanced Drainage Systems Inc, 5.000%, 30/09/27	120 625	0,02	255 000	USD Allison Transmission Inc, 3.750%, 30/01/31	225 338	0,04
91 000	USD Advanced Drainage Systems Inc, 6.375%, 15/06/30	91 682	0,02				
228 000	USD Advantage Sales & Marketing Inc, 6.500%, 15/11/28	210 104	0,04				
213 000	USD AECOM, 5.125%, 15/03/27	211 445	0,04				
125 000	USD AerCap Global Aviation Trust, 6.500%, 15/06/45	125 186	0,02				
233 000	USD Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 8.250%, 15/02/26	234 165	0,04				
191 000	USD Affinity Interactive, 6.875%, 15/12/27	170 185	0,03				
85 000	USD AG Issuer LLC, 6.250%, 01/03/28	84 494	0,02				
185 000	USD AG TTMT Escrow Issuer LLC, 8.625%, 30/09/27	194 508	0,04				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
250 000	USD Ally Financial Inc, 5.750%, 20/11/25	249 307	0,05	242 000	USD Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 5.750%, 01/03/27	240 149	0,05
117 000	USD Ally Financial Inc, 6.700%, 14/02/33	117 165	0,02	200 000	USD Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 5.750%, 15/01/28	197 982	0,04
250 000	USD Alta Equipment Group Inc, 5.625%, 15/04/26	241 172	0,05	178 000	USD Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 5.375%, 15/06/29	171 298	0,03
94 000	USD Alteryx Inc, 8.750%, 15/03/28	100 062	0,02	128 000	USD Antero Resources Corp, 7.625%, 01/02/29	131 357	0,03
306 000	USD AMC Entertainment Holdings Inc, 10.000%, 15/06/26	265 381	0,05	124 000	USD Antero Resources Corp, 5.375%, 01/03/30	118 840	0,02
160 000	USD AMC Entertainment Holdings Inc, 7.500%, 15/02/29	111 134	0,02	55 000	USD Api Group De Inc, 4.125%, 15/07/29	50 048	0,01
272 000	USD AMC Networks Inc, 4.750%, 01/08/25	264 853	0,05	50 000	USD APi Group DE Inc, 4.750%, 15/10/29	46 966	0,01
358 000	USD AMC Networks Inc, 4.250%, 15/02/29	274 067	0,05	171 000	USD Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 4.625%, 15/06/29	143 767	0,03
114 000	USD American Airlines Group Inc, 3.750%, 01/03/25	111 193	0,02	154 000	USD Aptim Corp, 7.750%, 15/06/25	144 986	0,03
410 000	USD American Airlines Inc, 7.250%, 15/02/28	413 974	0,08	91 000	USD APX Group Inc, 6.750%, 15/02/27	90 773	0,02
330 000	USD American Airlines Inc, 8.500%, 15/05/29	348 437	0,07	284 000	USD APX Group Inc, 5.750%, 15/07/29	264 843	0,05
87 000	USD American Axle & Manufacturing Inc, 6.500%, 01/04/27	87 340	0,02	290 000	USD Aramark Services Inc, 5.000%, 01/02/28	281 295	0,05
150 000	USD American Axle & Manufacturing Inc, 6.875%, 01/07/28	147 383	0,03	247 000	USD Arches Buyer Inc, 4.250%, 01/06/28	223 702	0,04
197 000	USD American Axle & Manufacturing Inc, 5.000%, 01/10/29	173 967	0,03	102 000	USD Arches Buyer Inc, 6.125%, 01/12/28	88 230	0,02
105 000	USD American Builders & Contractors Supply Co Inc, 4.000%, 15/01/28	99 388	0,02	145 000	USD Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp, 6.875%, 01/04/27	145 362	0,03
110 000	USD American Builders & Contractors Supply Co Inc, 3.875%, 15/11/29	98 064	0,02	231 000	USD Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp, 6.250%, 01/04/28	227 535	0,04
179 000	USD AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5.500%, 20/05/25	176 477	0,03	45 000	USD Arcosa Inc, 4.375%, 15/04/29	41 912	0,01
175 000	USD AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5.875%, 20/08/26	173 179	0,03	246 429	USD Aretec Escrow Issuer 2 Inc, 10.000%, 15/08/30	261 868	0,05
139 000	USD AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5.750%, 20/05/27	135 083	0,03	270 000	USD Aretec Escrow Issuer Inc, 7.500%, 01/04/29	243 428	0,05
150 000	USD AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 9.375%, 01/06/28	154 929	0,03	100 000	USD Arko Corp, 5.125%, 15/11/29	86 250	0,02
304 000	USD AmeriTex HoldCo Intermediate LLC, 10.250%, 15/10/28	312 360	0,06	150 000	USD Armor Holdco Inc, 8.500%, 15/11/29	136 065	0,03
85 000	USD Amkor Technology Inc, 6.625%, 15/09/27	86 066	0,02	167 000	USD Arsenal AIC Parent LLC, 8.000%, 01/10/30	174 241	0,03
167 000	USD AMN Healthcare Inc, 4.625%, 01/10/27	158 024	0,03	265 000	USD Artera Services LLC, 9.033%, 04/12/25	251 178	0,05
111 000	USD AMN Healthcare Inc, 4.000%, 15/04/29	100 112	0,02	125 000	USD Asbury Automotive Group Inc, 4.500%, 01/03/28	118 719	0,02
125 000	USD Amsted Industries Inc, 5.625%, 01/07/27	124 554	0,02	200 000	USD Asbury Automotive Group Inc, 4.625%, 15/11/29	185 179	0,04
95 000	USD Amsted Industries Inc, 4.625%, 15/05/30	86 946	0,02	160 000	USD Asbury Automotive Group Inc, 5.000%, 15/02/32	145 497	0,03
236 000	USD AmWINS Group Inc, 4.875%, 30/06/29	215 209	0,04	190 000	USD Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp, 7.000%, 01/11/26	191 330	0,04
93 000	USD Angi Group LLC, 3.875%, 15/08/28	78 570	0,02	200 000	USD Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp, 8.250%, 31/12/28	201 103	0,04
91 000	USD Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 7.875%, 15/05/26	93 297	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
150 000 USD	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp, 5.875%, 30/06/29	139 309	0,03	314 000 USD	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc, 4.750%, 01/04/28	289 128	0,06
90 000 USD	ASGN Inc, 4.625%, 15/05/28	85 501	0,02	97 000 USD	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc, 5.375%, 01/03/29	89 740	0,02
75 000 USD	Ashland Inc, 3.375%, 01/09/31	64 646	0,01	150 000 USD	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc, 8.000%, 15/02/31	149 785	0,03
75 000 USD	Ashland Inc, 6.875%, 15/05/43	73 518	0,01	160 000 USD	Axalta Coating Systems LLC, 3.375%, 15/02/29	143 714	0,03
130 000 USD	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co, 6.625%, 15/01/28	126 119	0,02	200 000 USD	Azul Secured Finance LLP, 10.875%, 28/05/30	165 016	0,03
100 000 USD	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co, 4.625%, 01/08/29	88 925	0,02	57 000 USD	B&G Foods Inc, 5.250%, 01/04/25	56 125	0,01
50 000 USD	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co, 4.625%, 01/04/30	44 581	0,01	178 000 USD	B&G Foods Inc, 5.250%, 15/09/27	161 547	0,03
182 000 USD	ASP Unifrax Holdings Inc, 5.250%, 30/09/28	131 423	0,03	126 000 USD	B&G Foods Inc, 8.000%, 15/09/28	132 308	0,03
50 000 USD	ASP Unifrax Holdings Inc, 7.500%, 30/09/29	25 435	0,00	200 000 USD	Ball Corp, 5.250%, 01/07/25	199 803	0,04
100 000 USD	Associated Banc Corp, 4.250%, 15/01/25	98 252	0,02	199 000 USD	Ball Corp, 4.875%, 15/03/26	198 273	0,04
70 000 USD	Assurant Inc, 7.000%, 27/03/48	70 587	0,01	175 000 EUR	Ball Corp, 1.500%, 15/03/27	180 855	0,03
85 000 USD	AssuredPartners Inc, 7.000%, 15/08/25	85 132	0,02	125 000 USD	Ball Corp, 6.875%, 15/03/28	129 950	0,02
92 000 USD	AssuredPartners Inc, 5.625%, 15/01/29	85 873	0,02	165 000 USD	Ball Corp, 6.000%, 15/06/29	168 499	0,03
50 000 USD	At Home Group Inc, 4.875%, 15/07/28	18 500	0,00	360 000 USD	Ball Corp, 2.875%, 15/08/30	308 947	0,06
600 000 USD	AthenaHealth Group Inc, 6.500%, 15/02/30	544 693	0,10	167 000 USD	Ball Corp, 3.125%, 15/09/31	144 115	0,03
50 000 USD	ATI Inc, 5.875%, 01/12/27	49 324	0,01	50 000 USD	Bath & Body Works Inc, 9.375%, 01/07/25	52 787	0,01
160 000 USD	ATI Inc, 4.875%, 01/10/29	148 756	0,03	158 000 USD	Bath & Body Works Inc, 6.694%, 15/01/27	161 327	0,03
75 000 USD	ATI Inc, 7.250%, 15/08/30	78 000	0,01	172 000 USD	Bath & Body Works Inc, 5.250%, 01/02/28	170 150	0,03
50 000 USD	ATI Inc, 5.125%, 01/10/31	46 470	0,01	240 000 USD	Bath & Body Works Inc, 6.625%, 01/10/30	245 494	0,05
70 000 USD	Atkore Inc, 4.250%, 01/06/31	62 476	0,01	60 000 USD	Bath & Body Works Inc, 6.950%, 01/03/33	59 953	0,01
25 000 USD	Audacy Capital Corp, 6.500%, 01/05/27	438	0,00	250 000 USD	Bath & Body Works Inc, 6.875%, 01/11/35	253 170	0,05
149 000 USD	Audacy Capital Corp, 6.750%, 31/03/29	2 235	0,00	120 000 USD	Bath & Body Works Inc, 6.750%, 01/07/36	120 920	0,02
100 000 EUR	Avantor Funding Inc, 2.625%, 01/11/25	107 898	0,02	150 000 USD	Bausch Health Americas Inc, 9.250%, 01/04/26	137 260	0,03
100 000 EUR	Avantor Funding Inc, 3.875%, 15/07/28	107 980	0,02	220 000 USD	Bausch Health Americas Inc, 8.500%, 31/01/27	122 194	0,02
279 000 USD	Avantor Funding Inc, 4.625%, 15/07/28	269 570	0,05	214 000 USD	BCPE Empire Holdings Inc, 7.625%, 01/05/27	206 503	0,04
355 000 USD	Avantor Funding Inc, 3.875%, 01/11/29	322 338	0,06	125 000 USD	BCPE Ulysses Intermediate Inc, 7.750%, 01/04/27	116 502	0,02
95 000 USD	Avient Corp, 5.750%, 15/05/25	95 002	0,02	200 000 USD	Beacon Roofing Supply Inc, 4.500%, 15/11/26	193 934	0,04
180 000 USD	Avient Corp, 7.125%, 01/08/30	187 356	0,04	90 000 USD	Beacon Roofing Supply Inc, 4.125%, 15/05/29	81 797	0,02
65 000 USD	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc, 5.750%, 15/07/27	63 009	0,01	100 000 USD	Beasley Mezzanine Holdings LLC, 8.625%, 01/02/26	66 000	0,01
175 000 USD	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc, 5.750%, 15/07/27	167 700	0,03	100 000 USD	Beazer Homes USA Inc, 5.875%, 15/10/27	97 669	0,02
				65 000 USD	Beazer Homes USA Inc, 7.250%, 15/10/29	65 571	0,01
				200 000 EUR	Belden Inc, 3.375%, 15/07/27	213 222	0,04
				100 000 EUR	Belden Inc, 3.875%, 15/03/28	107 151	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
130 000	USD BellRing Brands Inc, 7.000%, 15/03/30	134 758	0,03	231 000	USD Brink's Co, 4.625%, 15/10/27	220 393	0,04
36 000	USD Berry Global Inc, 4.500%, 15/02/26	35 036	0,01	165 000	USD Bristow Group Inc, 6.875%, 01/03/28	158 400	0,03
78 000	USD Berry Global Inc, 5.625%, 15/07/27	77 419	0,01	153 000	USD BroadStreet Partners Inc, 5.875%, 15/04/29	142 827	0,03
150 000	USD Berry Petroleum Co LLC, 7.000%, 15/02/26	146 542	0,03	336 000	USD Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSI Sellco LL, 5.750%, 15/05/26	325 754	0,06
200 000	USD Big River Steel LLC / BRS Finance Corp, 6.625%, 31/01/29	203 916	0,04	230 000	USD Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSI Sellco LL, 4.500%, 01/04/27	207 000	0,04
175 000	USD Blackstone Mortgage Trust Inc, 3.750%, 15/01/27	155 658	0,03	50 000	USD Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 6.000%, 01/02/26	49 976	0,01
45 000	USD Block Communications Inc, 4.875%, 01/03/28	39 375	0,01	53 000	USD Buckeye Partners LP, 4.350%, 15/10/24	51 939	0,01
196 000	USD Block Inc, 2.750%, 01/06/26	184 850	0,04	169 000	USD Buckeye Partners LP, 4.125%, 01/03/25	164 775	0,03
230 000	USD Block Inc, 3.500%, 01/06/31	204 240	0,04	148 000	USD Buckeye Partners LP, 3.950%, 01/12/26	139 860	0,03
125 000	USD Bloomin' Brands Inc / OSI Restaurant Partners LLC, 5.125%, 15/04/29	114 782	0,02	75 000	USD Buckeye Partners LP, 4.125%, 01/12/27	71 250	0,01
195 000	USD Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 7.625%, 15/12/25	197 528	0,04	175 000	USD Buckeye Partners LP, 5.850%, 15/11/43	141 767	0,03
50 000	USD Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 6.625%, 15/07/26	49 500	0,01	150 000	USD Buckeye Partners LP, 5.600%, 15/10/44	115 420	0,02
145 000	USD BlueLinx Holdings Inc, 6.000%, 15/11/29	134 187	0,03	141 000	USD Builders FirstSource Inc, 5.000%, 01/03/30	136 168	0,03
60 000	USD Boise Cascade Co, 4.875%, 01/07/30	56 336	0,01	334 000	USD Builders FirstSource Inc, 4.250%, 01/02/32	301 243	0,06
100 000	EUR Boxer Parent Co Inc, 6.500%, 02/10/25	110 045	0,02	127 000	USD Builders FirstSource Inc, 6.375%, 15/06/32	129 721	0,02
91 000	USD Boxer Parent Co Inc, 7.125%, 02/10/25	91 488	0,02	75 000	USD Burford Capital Global Finance LLC, 6.250%, 15/04/28	71 920	0,01
50 000	USD Boxer Parent Co Inc, 9.125%, 01/03/26	49 969	0,01	100 000	USD Burford Capital Global Finance LLC, 6.875%, 15/04/30	96 507	0,02
230 000	USD Boyd Gaming Corp, 4.750%, 01/12/27	221 254	0,04	200 000	USD Burford Capital Global Finance LLC, 9.250%, 01/07/31	212 560	0,04
235 000	USD Boyd Gaming Corp, 4.750%, 15/06/31	215 852	0,04	163 000	USD C&S Group Enterprises LLC, 5.000%, 15/12/28	131 104	0,03
111 000	USD Boyne USA Inc, 4.750%, 15/05/29	104 383	0,02	109 000	USD Cable One Inc, 4.000%, 15/11/30	88 251	0,02
438 000	USD Brand Industrial Services Inc, 10.375%, 01/08/30	463 198	0,09	125 000	USD Cablevision Lightpath LLC, 3.875%, 15/09/27	109 769	0,02
100 000	USD Brandywine Operating Partnership LP, 4.100%, 01/10/24	97 909	0,02	125 000	USD Cablevision Lightpath LLC, 5.625%, 15/09/28	98 514	0,02
100 000	USD Brandywine Operating Partnership LP, 3.950%, 15/11/27	89 398	0,02	828 000	USD Caesars Entertainment Inc, 6.250%, 01/07/25	830 313	0,16
100 000	USD Brandywine Operating Partnership LP, 4.550%, 01/10/29	87 479	0,02	390 000	USD Caesars Entertainment Inc, 8.125%, 01/07/27	399 897	0,08
52 000	USD Bread Financial Holdings Inc, 7.000%, 15/01/26	51 674	0,01	198 000	USD Caesars Entertainment Inc, 4.625%, 15/10/29	178 545	0,03
139 000	USD Bread Financial Holdings Inc, 9.750%, 15/03/29	143 549	0,03	650 000	USD Caesars Entertainment Inc, 7.000%, 15/02/30	666 284	0,13
145 000	USD Brightsphere Investment Group Inc, 4.800%, 27/07/26	139 016	0,03	160 000	USD Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc, 5.750%, 01/07/25	159 945	0,03
100 000	USD Brinker International Inc, 8.250%, 15/07/30	104 608	0,02				
150 000	USD Brink's Co, 5.500%, 15/07/25	149 269	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
113 000 USD	Calderys Financing LLC, 11.250%, 01/06/28	118 355	0,02	888 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5.125%, 01/05/27	856 937	0,16
228 000 USD	Callon Petroleum Co, 8.000%, 01/08/28	233 052	0,04	636 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5.000%, 01/02/28	608 739	0,12
345 000 USD	Callon Petroleum Co, 7.500%, 15/06/30	347 991	0,07	436 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5.375%, 01/06/29	411 107	0,08
99 000 USD	Calpine Corp, 5.250%, 01/06/26	97 609	0,02	390 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 6.375%, 01/09/29	384 667	0,07
394 000 USD	Calpine Corp, 4.500%, 15/02/28	374 459	0,07	758 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4.750%, 01/03/30	692 505	0,13
335 000 USD	Calpine Corp, 5.125%, 15/03/28	321 213	0,06	629 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4.500%, 15/08/30	567 068	0,11
190 000 USD	Calpine Corp, 4.625%, 01/02/29	176 264	0,03	788 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4.250%, 01/02/31	688 742	0,13
232 000 USD	Calpine Corp, 5.000%, 01/02/31	212 713	0,04	300 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 7.375%, 01/03/31	307 711	0,06
354 000 USD	Calpine Corp, 3.750%, 01/03/31	310 960	0,06	310 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4.750%, 01/02/32	273 408	0,05
33 000 USD	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp, 11.000%, 15/04/25	33 436	0,01	758 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4.500%, 01/05/32	648 903	0,12
150 000 USD	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp, 8.125%, 15/01/27	147 375	0,03	514 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4.500%, 01/06/33	435 115	0,08
125 000 USD	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp, 9.750%, 15/07/28	125 000	0,02	394 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4.250%, 15/01/34	320 294	0,06
238 000 USD	Camelot Return Merger Sub Inc, 8.750%, 01/08/28	241 577	0,05	196 000 USD	CD&R Smokey Buyer Inc, 6.750%, 15/07/25	193 911	0,04
30 000 USD	Cano Health LLC, 6.250%, 01/10/28	2 102	0,00	394 000 USD	CDI Escrow Issuer Inc, 5.750%, 01/04/30	384 147	0,07
100 000 USD	Capstone Borrower Inc, 8.000%, 15/06/30	104 036	0,02	200 000 USD	CEC Entertainment LLC, 6.750%, 01/05/26	195 192	0,04
207 000 USD	Cargo Aircraft Management Inc, 4.750%, 01/02/28	189 448	0,04	75 000 USD	Cedar Fair Lp, 5.250%, perpetual	70 779	0,01
650 000 USD	Carnival Holdings Bermuda Ltd, 10.375%, 01/05/28	707 187	0,14	188 000 USD	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op, 5.500%, 01/05/25	187 048	0,04
100 000 USD	Carpenter Technology Corp, 6.375%, 15/07/28	100 425	0,02	92 000 USD	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op, 5.375%, 15/04/27	90 018	0,02
50 000 USD	Carpenter Technology Corp, 7.625%, 15/03/30	51 500	0,01	51 000 USD	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op, 6.500%, 01/10/28	50 698	0,01
38 000 USD	Carriage Purchaser Inc, 7.875%, 15/10/29	31 111	0,01	150 000 USD	Central Garden & Pet Co, 5.125%, 01/02/28	145 713	0,03
75 000 USD	Carriage Services Inc, 4.250%, 15/05/29	66 611	0,01	118 000 USD	Central Garden & Pet Co, 4.125%, 15/10/30	107 328	0,02
75 000 USD	Carrols Restaurant Group Inc, 5.875%, 01/07/29	66 233	0,01				
55 000 USD	Cars.Com Inc, 6.375%, perpetual	52 744	0,01				
35 000 USD	Castle US Holding Corp, 9.500%, 15/02/28	18 025	0,00				
120 000 USD	Catalent Pharma Solutions Inc, 5.000%, 15/07/27	116 333	0,02				
100 000 EUR	Catalent Pharma Solutions Inc, 2.375%, 01/03/28	95 966	0,02				
41 000 USD	Catalent Pharma Solutions Inc, 3.125%, 15/02/29	35 880	0,01				
316 000 USD	Catalent Pharma Solutions Inc, 3.500%, 01/04/30	275 033	0,05				
55 000 USD	CCM Merger Inc, 6.375%, 01/05/26	53 625	0,01				
105 000 USD	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5.500%, 01/05/26	104 307	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
75 000 USD	Central Garden & Pet Co, 4.125%, 30/04/31	66 291	0,01	273 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 4.750%, 15/02/31	215 479	0,04
200 000 USD	Central Parent Inc / CDK Global Inc, 7.250%, 15/06/29	204 389	0,04	228 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 10.875%, 15/01/32	238 812	0,05
125 000 USD	Central Parent LLC / CDK Global II LLC / CDK Financing Co Inc, 8.000%, 15/06/29	130 470	0,03	77 000 USD	Churchill Downs Inc, 5.500%, 01/04/27	76 190	0,01
45 000 USD	Century Aluminum Co, 7.500%, 01/04/28	43 552	0,01	186 000 USD	Churchill Downs Inc, 4.750%, 15/01/28	178 355	0,03
109 000 USD	Century Communities Inc, 6.750%, 01/06/27	110 295	0,02	140 000 USD	Churchill Downs Inc, 6.750%, 01/05/31	142 091	0,03
118 000 USD	Century Communities Inc, 3.875%, 15/08/29	106 816	0,02	50 000 USD	Ciena Corp, 4.000%, 31/01/30	45 503	0,01
75 000 USD	Charles River Laboratories International Inc, 4.250%, 01/05/28	71 307	0,01	218 000 USD	Cinemark Usa Inc, 5.250%, 15/07/28	199 830	0,04
153 000 USD	Charles River Laboratories International Inc, 3.750%, 15/03/29	140 105	0,03	50 000 USD	Cinemark USA Inc, 5.875%, 15/03/26	48 881	0,01
187 000 USD	Charles River Laboratories International Inc, 4.000%, 15/03/31	168 775	0,03	155 000 USD	Civitas Resources Inc, 5.000%, 15/10/26	150 303	0,03
372 000 USD	Chart Industries Inc, 7.500%, 01/01/30	389 242	0,07	420 000 USD	Civitas Resources Inc, 8.375%, 01/07/28	438 486	0,08
159 000 USD	Chart Industries Inc, 9.500%, 01/01/31	172 720	0,03	283 000 USD	Civitas Resources Inc, 8.625%, 01/11/30	300 113	0,06
200 000 EUR	Chemours Co, 4.000%, 15/05/26	216 788	0,04	368 000 USD	Civitas Resources Inc, 8.750%, 01/07/31	391 871	0,07
165 000 USD	Chemours Co, 5.375%, 15/05/27	161 185	0,03	234 000 USD	Clarivate Science Holdings Corp, 3.875%, 01/07/28	220 663	0,04
230 000 USD	Chemours Co, 5.750%, 15/11/28	219 079	0,04	235 000 USD	Clarivate Science Holdings Corp, 4.875%, 01/07/29	220 520	0,04
176 000 USD	Chemours Co, 4.625%, 15/11/29	154 490	0,03	93 000 USD	Clean Harbors Inc, 4.875%, 15/07/27	91 149	0,02
120 000 USD	Chesapeake Energy Corp, 5.500%, 01/02/26	119 002	0,02	75 000 USD	Clean Harbors Inc, 5.125%, 15/07/29	71 759	0,01
129 000 USD	Chesapeake Energy Corp, 5.875%, 01/02/29	126 436	0,02	25 000 USD	Clean Harbors Inc, 6.375%, 01/02/31	25 431	0,00
261 000 USD	Chesapeake Energy Corp, 6.750%, 15/04/29	263 477	0,05	246 000 USD	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 5.125%, 15/08/27	234 828	0,04
120 000 USD	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc, 7.500%, 15/04/25	119 400	0,02	338 000 USD	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 7.750%, 15/04/28	291 279	0,06
70 000 USD	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc, 4.625%, 15/11/28	65 437	0,01	225 000 USD	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 9.000%, 15/09/28	234 780	0,04
125 000 USD	Chord Energy Corp, 6.375%, 01/06/26	125 000	0,02	258 000 USD	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 7.500%, 01/06/29	214 415	0,04
228 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 8.000%, 15/03/26	227 246	0,04	55 000 USD	Clearwater Paper Corp, 4.750%, 15/08/28	50 981	0,01
511 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 5.625%, 15/03/27	474 836	0,09	316 000 USD	Clearway Energy Operating LLC, 4.750%, 15/03/28	304 283	0,06
133 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 8.000%, 15/12/27	128 332	0,02	332 000 USD	Clearway Energy Operating LLC, 3.750%, 15/02/31	292 197	0,06
230 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 6.875%, 01/04/28	141 162	0,03	125 000 USD	Clearway Energy Operating LLC, 3.750%, 15/01/32	108 562	0,02
397 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 6.000%, 15/01/29	357 352	0,07	250 000 USD	Cleveland-Cliffs Inc, 6.750%, 15/03/26	250 472	0,05
370 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 6.875%, 15/04/29	242 428	0,05	101 000 USD	Cleveland-Cliffs Inc, 5.875%, 01/06/27	100 653	0,02
300 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 6.125%, 01/04/30	194 232	0,04	145 000 USD	Cleveland-Cliffs Inc, 4.625%, 01/03/29	134 235	0,03
495 000 USD	CHS/Community Health Systems Inc, 5.250%, 15/05/30	415 105	0,08	200 000 USD	Cleveland-Cliffs Inc, 6.750%, 15/04/30	202 929	0,04

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
41 000 USD	Cleveland-Cliffs Inc, 4.875%, 01/03/31	37 045	0,01	448 000 USD	Comstock Resources Inc, 6.750%, 01/03/29	409 796	0,08
1 070 000 USD	Cloud Software Group Inc, 6.500%, 31/03/29	1 019 535	0,19	261 000 USD	Comstock Resources Inc, 5.875%, 15/01/30	226 256	0,04
1 005 000 USD	Cloud Software Group Inc, 9.000%, 30/09/29	957 313	0,18	173 000 USD	Conduent Business Services LLC / Conduent State & Local Solutions Inc, 6.000%, 01/11/29	155 764	0,03
102 000 USD	ClubCorp Holdings Inc, 8.500%, 15/09/25	90 780	0,02	50 000 USD	Consensus Cloud Solutions Inc, 6.000%, 15/10/26	47 543	0,01
100 000 USD	Clydesdale Acquisition Holdings Inc, 6.625%, 15/04/29	98 357	0,02	193 000 USD	Consensus Cloud Solutions Inc, 6.500%, 15/10/28	175 062	0,03
300 000 USD	Clydesdale Acquisition Holdings Inc, 8.750%, 15/04/30	279 710	0,05	145 000 USD	Consolidated Communications Inc, 5.000%, 01/10/28	118 900	0,02
265 000 USD	CMG Media Corp, 8.875%, 15/12/27	210 179	0,04	161 000 USD	Consolidated Communications Inc, 6.500%, 01/10/28	138 798	0,03
70 000 USD	CNX Midstream Partners LP, 4.750%, 15/04/30	62 919	0,01	117 000 USD	Constellation Insurance Inc, 6.800%, 24/01/30	110 952	0,02
112 000 USD	CNX Resources Corp, 7.250%, 14/03/27	112 994	0,02	166 105 USD	Cooper-Standard Automotive Inc, 13.500%, 31/03/27	179 716	0,03
278 000 USD	CNX Resources Corp, 6.000%, 15/01/29	266 484	0,05	149 153 USD	Cooper-Standard Automotive Inc, 5.625%, 15/05/27	111 865	0,02
70 000 USD	Cobra AcquisitionCo LLC, 6.375%, 01/11/29	53 949	0,01	200 000 USD	CoreCivic Inc, 8.250%, 15/04/26	203 470	0,04
119 000 USD	Coeur Mining Inc, 5.125%, 15/02/29	109 597	0,02	150 000 USD	CoreCivic Inc, 4.750%, 15/10/27	137 921	0,03
78 000 USD	Cogent Communications Group Inc, 3.500%, 01/05/26	74 674	0,01	226 000 USD	CoreLogic Inc, 4.500%, 01/05/28	197 978	0,04
100 000 USD	Cogent Communications Group Inc, 7.000%, 15/06/27	100 500	0,02	70 000 USD	Cornerstone Building Brands Inc, 6.125%, 15/01/29	57 400	0,01
275 000 USD	Coherent Corp, 5.000%, 15/12/29	261 183	0,05	155 000 USD	Cornerstone Chemical Co, 10.250%, 01/09/27	130 975	0,03
413 000 USD	Coinbase Global Inc, 3.375%, 01/10/28	348 756	0,07	200 000 EUR	Coty Inc, 3.875%, 15/04/26	220 070	0,04
240 000 USD	Coinbase Global Inc, 3.625%, 01/10/31	185 554	0,04	38 000 USD	Coty Inc, 6.500%, 15/04/26	37 948	0,01
50 000 USD	Commercial Metals Co, 4.125%, 15/01/30	45 824	0,01	200 000 EUR	Coty Inc, 5.750%, 15/09/28	232 197	0,04
50 000 USD	Commercial Metals Co, 3.875%, 15/02/31	44 250	0,01	280 000 USD	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC, 4.750%, 15/01/29	267 079	0,05
55 000 USD	Commercial Metals Co, 4.375%, 15/03/32	49 370	0,01	211 000 USD	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC, 6.625%, 15/07/30	217 050	0,04
329 000 USD	CommScope Inc, 6.000%, 01/03/26	293 297	0,06	135 000 USD	Covanta Holding Corp, 4.875%, 01/12/29	117 948	0,02
242 000 USD	CommScope Inc, 8.250%, 01/03/27	127 776	0,02	200 000 USD	Covanta Holding Corp, 5.000%, 01/09/30	170 232	0,03
117 000 USD	CommScope Inc, 7.125%, 01/07/28	55 575	0,01	170 000 USD	CP Atlas Buyer Inc, 7.000%, 01/12/28	147 990	0,03
218 000 USD	CommScope Inc, 4.750%, 01/09/29	146 366	0,03	97 000 USD	CPI CG Inc, 8.625%, 15/03/26	93 605	0,02
350 000 USD	CommScope Technologies LLC, 6.000%, 15/06/25	285 250	0,05	330 000 USD	CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.500%, 15/06/31	312 649	0,06
100 000 USD	CommScope Technologies LLC, 5.000%, 15/03/27	41 625	0,01	50 000 USD	Crane NXT Co, 4.200%, 15/03/48	37 548	0,01
176 000 USD	Compass Group Diversified Holdings LLC, 5.250%, 15/04/29	166 253	0,03	175 000 USD	Credit Acceptance Corp, 6.625%, 15/03/26	174 646	0,03
70 000 USD	Compass Group Diversified Holdings LLC, 5.000%, 15/01/32	63 051	0,01	113 000 USD	Credit Acceptance Corp, 9.250%, 15/12/28	120 503	0,02
163 000 USD	Compass Minerals International Inc, 6.750%, 01/12/27	161 370	0,03	318 000 USD	Crescent Energy Finance LLC, 7.250%, 01/05/26	319 831	0,06
				320 000 USD	Crescent Energy Finance LLC, 9.250%, 15/02/28	332 022	0,06
				100 000 USD	Crocs Inc, 4.250%, 15/03/29	89 315	0,02
				60 000 USD	Crocs Inc, 4.125%, 15/08/31	50 678	0,01

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
156 000 USD	Crowdstrike Holdings Inc, 3.000%, 15/02/29	141 048	0,03	153 000 USD	CVR Energy Inc, 8.500%, 15/01/29	152 617	0,03
100 000 USD	Crown Americas LLC, 5.250%, 01/04/30	98 483	0,02	202 000 USD	CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp, 6.125%, 15/06/28	188 450	0,04
150 000 USD	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp V, 4.250%, 30/09/26	145 500	0,03	100 000 USD	Dana Inc, 5.375%, 15/11/27	99 311	0,02
130 000 USD	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI, 4.750%, 01/02/26	128 771	0,02	75 000 USD	Dana Inc, 5.625%, 15/06/28	73 944	0,01
125 000 USD	Crown Cork & Seal Co Inc, 7.375%, 15/12/26	131 250	0,03	150 000 USD	Dana Inc, 4.250%, 01/09/30	132 949	0,03
177 000 USD	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc, 5.625%, 15/10/25	176 765	0,03	60 000 USD	Dana Inc, 4.500%, 15/02/32	52 201	0,01
75 000 USD	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc, 5.000%, 01/05/29	73 125	0,01	45 000 USD	Danaos Corp, 8.500%, 01/03/28	45 675	0,01
125 000 USD	CSC Holdings LLC, 5.250%, 01/06/24	122 405	0,02	45 000 USD	Darling Ingredients Inc, 5.250%, 15/04/27	44 293	0,01
350 000 USD	CSC Holdings LLC, 5.500%, 15/04/27	323 687	0,06	265 000 USD	Darling Ingredients Inc, 6.000%, 15/06/30	265 174	0,05
250 000 USD	CSC Holdings LLC, 5.375%, 01/02/28	220 665	0,04	100 000 USD	Dave & Buster's Inc, 7.625%, 01/11/25	101 250	0,02
150 000 USD	CSC Holdings LLC, 7.500%, 01/04/28	112 213	0,02	698 000 USD	DaVita Inc, 4.625%, 01/06/30	608 788	0,12
250 000 USD	CSC Holdings LLC, 11.250%, 15/05/28	257 590	0,05	341 000 USD	DaVita Inc, 3.750%, 15/02/31	280 037	0,05
470 000 USD	CSC Holdings LLC, 6.500%, 01/02/29	414 822	0,08	170 000 USD	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC, 8.000%, 01/02/28	168 300	0,03
640 000 USD	CSC Holdings LLC, 5.750%, 15/01/30	398 400	0,08	150 000 USD	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp, 7.125%, 01/06/28	141 298	0,03
250 000 USD	CSC Holdings LLC, 4.125%, 01/12/30	190 187	0,04	286 000 USD	Delta Air Lines Inc, 7.375%, 15/01/26	295 652	0,06
600 000 USD	CSC Holdings LLC, 4.625%, 01/12/30	361 469	0,07	120 000 USD	Delta Air Lines Inc, 4.375%, 19/04/28	116 076	0,02
250 000 USD	CSC Holdings LLC, 3.375%, 15/02/31	182 468	0,03	70 000 USD	Delta Air Lines Inc, 3.750%, 28/10/29	64 073	0,01
420 000 USD	CSC Holdings LLC, 4.500%, 15/11/31	317 549	0,06	143 000 USD	Deluxe Corp, 8.000%, 01/06/29	126 513	0,02
130 000 USD	CSI Compressco LP / CSI Compressco Finance Inc, 7.500%, 01/04/25	129 858	0,02	988 000 USD	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 5.875%, 15/08/27	928 937	0,18
65 000 USD	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 3.875%, perpetual	59 377	0,01	569 000 USD	DISH DBS Corp, 7.750%, 01/07/26	396 314	0,08
125 000 USD	Cumulus Media New Holdings Inc, 6.750%, 01/07/26	84 063	0,02	700 000 USD	DISH DBS Corp, 5.250%, 01/12/26	599 725	0,11
249 000 USD	Curo Group Holdings Corp, 7.500%, 01/08/28	47 931	0,01	258 000 USD	DISH DBS Corp, 7.375%, 01/07/28	154 227	0,03
200 000 USD	Curo Group Holdings Corp, 7.500%, 01/08/28	67 000	0,01	680 000 USD	DISH DBS Corp, 5.750%, 01/12/28	542 368	0,10
267 000 USD	Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 6.750%, 15/05/28	265 665	0,05	406 000 USD	DISH DBS Corp, 5.125%, 01/06/29	209 248	0,04
267 000 USD	Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 8.875%, 01/09/31	282 959	0,05	885 000 USD	DISH Network Corp, 11.750%, 15/11/27	926 541	0,18
201 000 USD	CVR Energy Inc, 5.250%, 15/02/25	200 679	0,04	141 000 USD	Diversified Healthcare Trust, 9.750%, 15/06/25	138 392	0,03
125 000 USD	CVR Energy Inc, 5.750%, 15/02/28	115 312	0,02	127 000 USD	Diversified Healthcare Trust, 4.750%, 15/02/28	97 527	0,02
				145 000 USD	Diversified Healthcare Trust, 4.375%, 01/03/31	108 750	0,02
				259 000 USD	Domtar Corp, 6.750%, 01/10/28	234 083	0,04
				100 000 USD	Dornoch Debt Merger Sub Inc, 6.625%, 15/10/29	90 157	0,02
				56 000 USD	Dream Finders Homes Inc, 8.250%, 15/08/28	59 181	0,01
				160 000 USD	Dresdner Funding Trust I, 8.151%, 30/06/31	176 400	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
167 000 USD	DT Midstream Inc, 4.125%, 15/06/29	153 647	0,03	273 000 USD	EnLink Midstream LLC, 5.625%, 15/01/28	269 994	0,05
238 000 USD	DT Midstream Inc, 4.375%, 15/06/31	214 578	0,04	165 000 USD	EnLink Midstream LLC, 5.375%, 01/06/29	161 462	0,03
100 000 USD	Dun & Bradstreet Corp, 5.000%, 15/12/29	93 282	0,02	180 000 USD	EnLink Midstream LLC, 6.500%, 01/09/30	183 718	0,04
78 000 USD	Dycom Industries Inc, 4.500%, 15/04/29	72 378	0,01	100 000 USD	EnLink Midstream Partners LP, 4.150%, 01/06/25	97 750	0,02
175 000 USD	Eco Material Technologies Inc, 7.875%, 31/01/27	175 000	0,03	70 000 USD	EnLink Midstream Partners LP, 4.850%, 15/07/26	68 579	0,01
313 000 USD	Edgewell Personal Care Co, 5.500%, 01/06/28	307 131	0,06	75 000 USD	EnLink Midstream Partners LP, 5.600%, 01/04/44	65 223	0,01
95 000 USD	Edgewell Personal Care Co, 4.125%, 01/04/29	86 450	0,02	170 000 USD	EnLink Midstream Partners LP, 5.050%, 01/04/45	140 675	0,03
300 000 USD	Edison International, 8.125%, 15/06/53	306 251	0,06	75 000 USD	EnLink Midstream Partners LP, 5.450%, 01/06/47	65 438	0,01
262 000 USD	Edison International, 7.875%, 15/06/54	263 965	0,05	100 000 USD	Enova International Inc, 8.500%, 15/09/25	98 250	0,02
164 000 USD	Elanco Animal Health Inc, 6.650%, 28/08/28	169 935	0,03	125 000 USD	Enova International Inc, 11.250%, 15/12/28	128 777	0,02
97 000 USD	Elastic Nv, 4.125%, 15/07/29	89 070	0,02	25 000 USD	EnPro Industries Inc, 5.750%, 15/10/26	24 745	0,00
180 000 USD	Element Solutions Inc, 3.875%, 01/09/28	165 738	0,03	400 000 USD	Entegris Escrow Corp, 4.750%, 15/04/29	385 226	0,07
318 000 USD	Embarq Corp, 7.995%, 01/06/36	196 365	0,04	195 000 USD	Entegris Escrow Corp, 5.950%, 15/06/30	193 655	0,04
191 000 USD	Embecta Corp, 5.000%, 15/02/30	162 014	0,03	50 000 USD	Entegris Inc, 4.375%, 15/04/28	47 583	0,01
100 000 EUR	Emerald Debt Merger Sub LLC, 6.375%, 15/12/30	117 982	0,02	55 000 USD	Entegris Inc, 3.625%, 01/05/29	49 678	0,01
650 000 USD	Emerald Debt Merger Sub LLC, 6.625%, 15/12/30	663 890	0,13	143 000 USD	Enviri Corp, 5.750%, 31/07/27	133 337	0,03
155 000 USD	Emergent BioSolutions Inc, 3.875%, 15/08/28	62 775	0,01	222 000 USD	Enviva Partners LP / Enviva Partners Finance Corp, 6.500%, 15/01/26	109 331	0,02
125 000 USD	Empire Resorts Inc, 7.750%, 01/11/26	107 500	0,02	45 000 USD	EQM Midstream Partners LP, 6.000%, 01/07/25	44 989	0,01
178 000 USD	Encino Acquisition Partners Holdings LLC, 8.500%, 01/05/28	175 330	0,03	114 000 USD	EQM Midstream Partners LP, 4.125%, 01/12/26	110 135	0,02
40 000 USD	Encompass Health Corp, 5.750%, 15/09/25	39 835	0,01	100 000 USD	EQM Midstream Partners LP, 7.500%, 01/06/27	102 867	0,02
181 000 USD	Encompass Health Corp, 4.500%, 01/02/28	173 206	0,03	239 000 USD	EQM Midstream Partners LP, 6.500%, 01/07/27	243 324	0,05
177 000 USD	Encompass Health Corp, 4.750%, 01/02/30	166 793	0,03	232 000 USD	EQM Midstream Partners LP, 5.500%, 15/07/28	229 831	0,04
60 000 USD	Encompass Health Corp, 4.625%, 01/04/31	55 214	0,01	180 000 USD	EQM Midstream Partners LP, 4.500%, 15/01/29	170 117	0,03
100 000 EUR	Encore Capital Group Inc, 4.875%, 15/10/25	110 005	0,02	145 000 USD	EQM Midstream Partners LP, 7.500%, 01/06/30	155 889	0,03
100 000 GBP	Encore Capital Group Inc, 4.250%, 01/06/28	108 677	0,02	230 000 USD	EQM Midstream Partners LP, 4.750%, 15/01/31	214 047	0,04
230 000 USD	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 5.750%, 30/01/28	230 217	0,04	150 000 USD	EQM Midstream Partners LP, 6.500%, 15/07/48	153 340	0,03
250 000 USD	Energizer Holdings Inc, 6.500%, 31/12/27	250 000	0,05	290 000 USD	EquipmentShare.com Inc, 9.000%, 15/05/28	299 091	0,06
95 000 USD	Energizer Holdings Inc, 4.750%, 15/06/28	88 410	0,02	135 000 USD	Evergreen Acqco 1 LP / TVI Inc, 9.750%, 26/04/28	143 775	0,03
205 000 USD	Energizer Holdings Inc, 4.375%, 31/03/29	184 276	0,04	100 000 USD	Everi Holdings Inc, 5.000%, 15/07/29	91 008	0,02
105 000 USD	EnerSys, 4.375%, 15/12/27	99 750	0,02	120 000 USD	Fair Isaac Corp, 5.250%, 15/05/26	119 146	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
150 000	USD Fair Isaac Corp, 4.000%, 15/06/28	141 883	0,03	336 000	USD Frontier Communications Holdings LLC, 6.000%, 15/01/30	286 791	0,05
159 000	USD Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp, 5.375%, 01/04/26	155 684	0,03	290 000	USD Frontier Communications Holdings LLC, 8.750%, 15/05/30	298 326	0,06
182 000	USD Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp, 5.875%, 01/04/29	171 958	0,03	100 000	USD Frontier Communications Holdings LLC, 8.625%, 15/03/31	101 933	0,02
170 000	USD Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 4.625%, 15/01/29	154 253	0,03	120 000	USD Frontier Florida LLC, 6.860%, 01/02/28	116 086	0,02
300 000	USD Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 6.750%, 15/07/30	263 764	0,05	300 000	USD FTAI Infra Escrow Holdings LLC, 10.500%, perpetual	311 495	0,06
50 000	USD Finance of America Funding LLC, 7.875%, perpetual	40 125	0,01	125 000	USD Full House Resorts Inc, 8.250%, 15/02/28	117 500	0,02
123 000	USD First Student Bidco Inc / First Transit Parent Inc, 4.000%, 31/07/29	106 651	0,02	280 000	USD FXI Holdings Inc, 12.250%, 15/11/26	249 203	0,05
75 000	USD FirstCash Inc, 4.625%, 01/09/28	70 014	0,01	65 000	USD FXI Holdings Inc, 12.250%, 15/11/26	58 175	0,01
100 000	USD FirstCash Inc, 5.625%, 01/01/30	95 743	0,02	150 000	USD Gannett Holdings LLC, 6.000%, 01/11/26	132 375	0,03
173 000	USD Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 7.875%, 15/11/25	171 270	0,03	178 000	USD Gap Inc, 3.625%, 01/10/29	152 177	0,03
175 000	USD Foot Locker Inc, 4.000%, 01/10/29	144 812	0,03	182 000	USD Gap Inc, 3.875%, 01/10/31	149 758	0,03
165 000	USD Forestar Group Inc, 3.850%, 15/05/26	156 872	0,03	75 000	USD Garden Spinco Corp, 8.625%, 20/07/30	80 251	0,02
50 000	USD Forestar Group Inc, 5.000%, 01/03/28	48 134	0,01	97 000	USD Gates Global LLC / Gates Corp, 6.250%, 15/01/26	96 515	0,02
153 000	USD Fortrea Holdings Inc, 7.500%, 01/07/30	157 200	0,03	181 000	USD GCI LLC, 4.750%, 15/10/28	167 401	0,03
106 000	USD Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 6.500%, 01/10/25	105 661	0,02	344 000	USD Gen Digital Inc, 5.000%, 15/04/25	340 560	0,07
125 000	USD Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 9.750%, 01/08/27	130 000	0,02	250 000	USD Gen Digital Inc, 6.750%, 30/09/27	254 243	0,05
267 000	USD Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 5.500%, 01/05/28	256 923	0,05	184 000	USD Gen Digital Inc, 7.125%, 30/09/30	192 251	0,04
108 333	USD Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 7.875%, 01/12/30	112 867	0,02	50 000	USD Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 6.250%, 15/05/26	49 951	0,01
70 000	USD Foundation Building Materials Inc, 6.000%, 01/03/29	62 939	0,01	262 000	USD Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8.000%, 15/01/27	266 562	0,05
251 000	USD Freedom Mortgage Corp, 7.625%, 01/05/26	248 104	0,05	155 000	USD Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 7.750%, 01/02/28	155 539	0,03
178 000	USD Freedom Mortgage Corp, 6.625%, 15/01/27	169 616	0,03	132 000	USD Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8.250%, 15/01/29	135 677	0,03
260 000	USD Freedom Mortgage Corp, 12.000%, 01/10/28	283 953	0,05	175 000	USD Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8.875%, 15/04/30	180 885	0,03
205 000	USD Freedom Mortgage Corp, 12.250%, 01/10/30	224 733	0,04	100 000	USD Genting New York LLC / GENNY Capital Inc, 3.300%, 15/02/26	91 142	0,02
238 000	USD Frontier Communications Holdings LLC, 5.875%, 15/10/27	229 903	0,04	145 000	USD Genworth Holdings Inc, 6.500%, 15/06/34	132 569	0,03
437 000	USD Frontier Communications Holdings LLC, 5.000%, 01/05/28	403 713	0,08	195 000	USD GEO Group Inc, 10.500%, 30/06/28	197 925	0,04
333 000	USD Frontier Communications Holdings LLC, 6.750%, 01/05/29	297 830	0,06	150 000	USD Getty Images Inc, 9.750%, 01/03/27	150 875	0,03
124 000	USD Frontier Communications Holdings LLC, 5.875%, 01/11/29	105 075	0,02	155 000	USD G-III Apparel Group Ltd, 7.875%, 15/08/25	155 000	0,03
				178 000	USD Glatfelter Corp, 4.750%, 15/11/29	125 089	0,02
				214 000	USD Global Atlantic Fin Co, 4.700%, 15/10/51	183 364	0,04

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
75 000 USD	Global Infrastructure Solutions Inc, 5.625%, 01/06/29	68 490	0,01	150 000 USD	Graphic Packaging International LLC, 3.750%, 01/02/30	135 000	0,03
100 000 USD	Global Infrastructure Solutions Inc, 7.500%, 15/04/32	92 213	0,02	229 000 USD	Gray Escrow II Inc, 5.375%, 15/11/31	173 476	0,03
230 000 USD	Global Marine Inc, 7.000%, 01/06/28	198 996	0,04	160 000 USD	Gray Television Inc, 5.875%, 15/07/26	156 006	0,03
174 000 USD	Global Medical Response Inc, 6.500%, 01/10/25	138 206	0,03	211 000 USD	Gray Television Inc, 7.000%, 15/05/27	200 555	0,04
190 000 USD	Global Net Lease Inc / Global Net Lease Operating Partnership LP, 3.750%, 15/12/27	158 884	0,03	304 000 USD	Gray Television Inc, 4.750%, 15/10/30	228 915	0,04
155 000 USD	Global Partners LP / GLP Finance Corp, 7.000%, 01/08/27	151 530	0,03	95 000 USD	Great Lakes Dredge & Dock Corp, 5.250%, 01/06/29	80 770	0,02
50 000 USD	Global Partners LP / GLP Finance Corp, 6.875%, 15/01/29	48 252	0,01	120 000 USD	Greystar Real Estate Partners LLC, 7.750%, 01/09/30	125 700	0,02
308 000 USD	GN Bondco LLC, 9.500%, 15/10/31	300 697	0,06	261 000 USD	Griffon Corp, 5.750%, 01/03/28	256 451	0,05
99 000 USD	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc, 5.250%, 01/12/27	97 011	0,02	128 000 USD	Group 1 Automotive Inc, 4.000%, 15/08/28	118 681	0,02
215 000 USD	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc, 3.500%, 01/03/29	195 507	0,04	199 000 USD	GrubHub Holdings Inc, 5.500%, 01/07/27	167 279	0,03
87 000 USD	Goodyear Tire & Rubber Co, 9.500%, 31/05/25	88 281	0,02	120 000 USD	GTCR AP Finance Inc, 8.000%, 15/05/27	121 207	0,02
250 000 USD	Goodyear Tire & Rubber Co, 5.000%, 31/05/26	246 157	0,05	550 000 USD	GTCR W-2 Merger Sub LLC, 7.500%, 15/01/31	581 197	0,11
226 000 USD	Goodyear Tire & Rubber Co, 4.875%, 15/03/27	218 798	0,04	175 000 USD	Guitar Center Inc, 8.500%, 15/01/26	153 134	0,03
142 000 USD	Goodyear Tire & Rubber Co, 5.000%, 15/07/29	134 198	0,03	175 000 USD	Gulfport Energy Corp, 8.000%, 17/05/26	176 899	0,03
137 000 USD	Goodyear Tire & Rubber Co, 5.250%, 30/04/31	125 379	0,02	145 000 USD	GYP Holdings III Corp, 4.625%, 01/05/29	132 371	0,03
250 000 USD	Goodyear Tire & Rubber Co, 5.250%, 15/07/31	226 837	0,04	304 000 USD	H&E Equipment Services Inc, 3.875%, 15/12/28	276 280	0,05
125 000 USD	Goodyear Tire & Rubber Co, 5.625%, 30/04/33	112 084	0,02	225 000 USD	Hanesbrands Inc, 4.875%, 15/05/26	217 007	0,04
206 000 USD	GoTo Group Inc, 5.500%, 01/09/27	99 641	0,02	160 000 USD	Hanesbrands Inc, 9.000%, 15/02/31	156 745	0,03
175 000 USD	GPD Cos Inc, 10.125%, 01/04/26	162 160	0,03	219 000 USD	Harvest Midstream I LP, 7.500%, 01/09/28	217 790	0,04
70 000 USD	GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc, 7.000%, 15/08/28	51 100	0,01	338 000 USD	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC, 3.375%, 15/06/26	317 673	0,06
129 000 USD	GrafTech Finance Inc, 4.625%, 15/12/28	85 515	0,02	148 000 USD	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC, 8.000%, 15/06/27	154 110	0,03
190 000 USD	GrafTech Global Enterprises Inc, 9.875%, 15/12/28	146 537	0,03	150 000 USD	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC, 3.750%, 15/09/30	126 278	0,02
130 000 USD	Graham Holdings Co, 5.750%, 01/06/26	129 025	0,02	288 000 USD	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 5.750%, 20/01/26	271 117	0,05
179 000 USD	Graham Packaging Co Inc, 7.125%, 15/08/28	161 100	0,03	50 000 USD	HB Fuller Co, 4.000%, 15/02/27	47 952	0,01
200 000 USD	Gran Tierra Energy Inc, 7.750%, 23/05/27	170 112	0,03	35 000 USD	HB Fuller Co, 4.250%, 15/10/28	32 727	0,01
100 000 USD	Grand Canyon University, 5.125%, 01/10/28	89 416	0,02	94 000 USD	HealthEquity Inc, 4.500%, 01/10/29	87 323	0,02
128 000 USD	Graphic Packaging International LLC, 4.750%, 15/07/27	124 160	0,02	50 000 USD	Heartland Dental LLC / Heartland Dental Finance Corp, 8.500%, 01/05/26	49 250	0,01
65 000 USD	Graphic Packaging International LLC, 3.500%, 15/03/28	60 565	0,01	270 000 USD	Heartland Dental LLC / Heartland Dental Finance Corp, 10.500%, 30/04/28	280 136	0,05
45 000 USD	Graphic Packaging International LLC, 3.500%, 01/03/29	40 492	0,01	100 000 USD	Hecla Mining Co, 7.250%, 15/02/28	100 668	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
200 000	USD Helios Software Holdings Inc / ION Corporate Solutions Finance Sarl, 4.625%, 01/05/28	182 452	0,03	256 000	USD Hologic Inc, 3.250%, 15/02/29	232 051	0,04
50 000	USD Helix Energy Solutions Group Inc, 9.750%, 01/03/29	52 581	0,01	151 000	USD Howard Hughes Corp, 5.375%, 01/08/28	145 130	0,03
303 000	USD Herc Holdings Inc, 5.500%, 15/07/27	299 076	0,06	249 000	USD Howard Hughes Corp, 4.125%, 01/02/29	222 036	0,04
130 000	USD Hertz Corp, 4.625%, 01/12/26	116 550	0,02	147 000	USD Howard Hughes Corp, 4.375%, 01/02/31	127 486	0,02
300 000	USD Hertz Corp, 5.000%, 01/12/29	246 141	0,05	150 000	USD Howard Midstream Energy Partners LLC, 6.750%, 15/01/27	148 541	0,03
139 000	USD Hess Midstream Operations LP, 5.125%, 15/06/28	134 109	0,03	150 000	USD Howard Midstream Energy Partners LLC, 8.875%, 15/07/28	157 435	0,03
260 000	USD Hess Midstream Operations LP, 4.250%, 15/02/30	239 200	0,05	385 000	USD HUB International Ltd, 7.000%, 01/05/26	386 488	0,07
80 000	USD Hess Midstream Operations LP, 5.500%, 15/10/30	77 424	0,01	170 000	USD HUB International Ltd, 5.625%, 01/12/29	162 454	0,03
60 000	USD HF Sinclair Corp, 6.375%, 15/04/27	60 499	0,01	520 000	USD HUB International Ltd, 7.250%, 15/06/30	549 240	0,10
172 000	USD HF Sinclair Corp, 5.000%, 01/02/28	165 739	0,03	321 000	USD Hughes Satellite Systems Corp, 5.250%, 01/08/26	282 471	0,05
100 000	USD H-Food Holdings LLC / Hearthside Finance Co Inc, 8.500%, 01/06/26	9 500	0,00	82 000	USD Hughes Satellite Systems Corp, 6.625%, 01/08/26	64 644	0,01
35 000	USD Hightower Holding LLC, 6.750%, 15/04/29	31 545	0,01	204 000	USD Hunt Cos Inc, 5.250%, 15/04/29	181 905	0,03
147 000	USD Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 6.250%, 01/11/28	146 418	0,03	182 000	USD Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6.375%, 15/12/25	178 679	0,03
249 000	USD Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 5.750%, 01/02/29	240 663	0,05	328 000	USD Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6.250%, 15/05/26	312 911	0,06
235 000	USD Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 6.000%, 15/04/30	228 011	0,04	328 000	USD Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 5.250%, 15/05/27	295 202	0,06
150 000	USD Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 6.000%, 01/02/31	144 684	0,03	136 000	USD Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 9.750%, 15/01/29	138 747	0,03
175 000	USD Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 6.250%, 15/04/32	168 286	0,03	218 000	USD Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 4.375%, 01/02/29	182 043	0,03
169 000	USD Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 8.375%, 01/11/33	179 045	0,03	232 000	USD iHeartCommunications Inc, 6.375%, 01/05/26	197 820	0,04
75 000	USD Hillenbrand Inc, 5.000%, 15/09/26	74 141	0,01	329 000	USD iHeartCommunications Inc, 8.375%, 01/05/27	213 546	0,04
65 000	USD Hillenbrand Inc, 3.750%, 01/03/31	56 111	0,01	205 000	USD iHeartCommunications Inc, 5.250%, 15/08/27	162 892	0,03
86 000	USD Hilton Domestic Operating Co Inc, 5.750%, 01/05/28	86 045	0,02	81 000	USD iHeartCommunications Inc, 4.750%, 15/01/28	62 314	0,01
232 000	USD Hilton Domestic Operating Co Inc, 3.750%, 01/05/29	215 139	0,04	178 000	USD Illuminate Buyer LLC / Illuminate Holdings IV Inc, 9.000%, 01/07/28	170 204	0,03
138 000	USD Hilton Domestic Operating Co Inc, 4.875%, 15/01/30	133 801	0,03	526 000	USD Imola Merger Corp, 4.750%, 15/05/29	499 921	0,10
150 000	USD Hilton Domestic Operating Co Inc, 4.000%, 01/05/31	137 429	0,03	149 000	USD Ingevity Corp, 3.875%, 01/11/28	133 406	0,03
344 000	USD Hilton Domestic Operating Co Inc, 3.625%, 15/02/32	300 319	0,06	50 000	USD Ingles Markets Inc, 4.000%, 15/06/31	44 125	0,01
282 000	USD Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 5.000%, 01/06/29	260 153	0,05	95 000	USD Innophos Holdings Inc, 9.375%, 15/02/28	86 266	0,02
100 000	USD Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4.875%, 01/04/27	98 495	0,02	45 000	USD INNOVATE Corp, 8.500%, 01/02/26	34 650	0,01
230 000	USD HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc, 4.875%, 01/06/29	180 598	0,03	45 000	USD Installed Building Products Inc, 5.750%, 01/02/28	43 650	0,01
50 000	USD Hologic Inc, 4.625%, 01/02/28	47 986	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
145 000	USD Interface Inc, 5.500%, 01/12/28	134 021	0,03	151 000	USD Kennedy-Wilson Inc, 4.750%, 01/03/29	126 073	0,02
100 000	EUR IQVIA Inc, 2.875%, 15/09/25	108 692	0,02	247 000	USD Kennedy-Wilson Inc, 4.750%, 01/02/30	200 201	0,04
200 000	EUR IQVIA Inc, 1.750%, 15/03/26	211 790	0,04	151 000	USD Kennedy-Wilson Inc, 5.000%, 01/03/31	119 894	0,02
260 000	USD IQVIA Inc, 5.000%, 15/10/26	257 550	0,05	120 000	USD KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC, 4.750%, 01/06/27	118 176	0,02
375 000	USD IQVIA Inc, 5.000%, 15/05/27	368 054	0,07	145 667	USD Kinetik Holdings LP, 6.625%, 15/12/28	148 427	0,03
100 000	EUR IQVIA Inc, 2.250%, 15/01/28	103 561	0,02	250 000	USD Kinetik Holdings LP, 5.875%, 15/06/30	245 315	0,05
200 000	EUR IQVIA Inc, 2.875%, 15/06/28	210 173	0,04	99 000	USD Kohl's Corp, 4.250%, 17/07/25	96 613	0,02
200 000	EUR IQVIA Inc, 2.250%, 15/03/29	202 151	0,04	143 000	USD Kohl's Corp, 4.625%, 01/05/31	112 535	0,02
70 000	USD Iris Holding Inc, 10.000%, 15/12/28	60 900	0,01	124 000	USD Kohl's Corp, 5.550%, 17/07/45	82 923	0,02
250 000	USD Iron Mountain Inc, 4.875%, 15/09/27	243 991	0,05	70 000	USD Kontoor Brands Inc, 4.125%, 15/11/29	63 175	0,01
148 000	USD Iron Mountain Inc, 5.250%, 15/03/28	143 883	0,03	50 000	USD Korn Ferry, 4.625%, 15/12/27	48 184	0,01
147 000	USD Iron Mountain Inc, 5.000%, 15/07/28	141 309	0,03	300 000	USD Kosmos Energy Ltd, 7.125%, 04/04/26	285 653	0,05
167 000	USD Iron Mountain Inc, 7.000%, 15/02/29	171 654	0,03	100 000	USD Kosmos Energy Ltd, 7.750%, 01/05/27	93 176	0,02
354 000	USD Iron Mountain Inc, 4.875%, 15/09/29	335 282	0,06	251 000	USD Kosmos Energy Ltd, 7.500%, 01/03/28	229 245	0,04
408 000	USD Iron Mountain Inc, 5.250%, 15/07/30	389 903	0,07	175 000	USD Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc, 5.000%, 31/12/26	170 625	0,03
310 000	USD Iron Mountain Inc, 4.500%, 15/02/31	282 583	0,05	68 000	USD Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc, 7.000%, 31/12/27	64 940	0,01
200 000	USD Iron Mountain Inc, 5.625%, 15/07/32	189 443	0,04	100 000	EUR Kronos International Inc, 3.750%, 15/09/25	105 577	0,02
235 000	USD Iron Mountain Information Management Services Inc, 5.000%, 15/07/32	214 725	0,04	135 000	USD LABL Inc, 6.750%, 15/07/26	131 275	0,03
346 000	USD ITT Holdings LLC, 6.500%, 01/08/29	306 085	0,06	113 000	USD LABL Inc, 10.500%, 15/07/27	108 402	0,02
153 000	USD Jacobs Entertainment Inc, 6.750%, 15/02/29	143 820	0,03	250 000	USD LABL Inc, 5.875%, 01/11/28	226 875	0,04
204 000	USD Jane Street Group / JSG Finance Inc, 4.500%, 15/11/29	190 233	0,04	93 000	USD LABL Inc, 9.500%, 01/11/28	93 930	0,02
133 000	USD JB Poindexter & Co Inc, 8.750%, 15/12/31	135 620	0,03	189 000	USD LABL Inc, 8.250%, 01/11/29	159 232	0,03
250 000	USD Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp, 5.000%, 15/08/28	223 999	0,04	150 000	USD Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 5.250%, 01/10/25	147 970	0,03
100 000	USD Jefferson Capital Holdings LLC, 6.000%, 15/08/26	95 707	0,02	276 000	USD Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 4.250%, 01/02/27	260 025	0,05
155 000	USD JELD-WEN Inc, 4.875%, 15/12/27	146 475	0,03	99 000	USD Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 4.750%, 15/06/29	89 249	0,02
140 000	USD JW Aluminum Continuous Cast Co, 10.250%, 01/06/26	140 930	0,03	146 000	USD Lamar Media Corp, 3.750%, 15/02/28	137 221	0,03
219 000	USD Kaiser Aluminum Corp, 4.625%, 01/03/28	202 539	0,04	155 000	USD Lamar Media Corp, 4.875%, 15/01/29	149 931	0,03
43 000	USD Kaiser Aluminum Corp, 4.500%, 01/06/31	37 069	0,01	133 000	USD Lamar Media Corp, 4.000%, 15/02/30	122 158	0,02
25 000	USD KB Home, 6.875%, 15/06/27	25 981	0,01	75 000	USD Lamar Media Corp, 3.625%, 15/01/31	66 638	0,01
40 000	USD KB Home, 4.800%, 15/11/29	38 220	0,01	97 000	USD Lamb Weston Holdings Inc, 4.875%, 15/05/28	94 868	0,02
100 000	USD KB Home, 7.250%, 15/07/30	103 485	0,02				
125 000	USD KB Home, 4.000%, 15/06/31	111 876	0,02				
100 000	USD KBR Inc, 4.750%, 30/09/28	92 675	0,02				
162 000	USD Ken Garff Automotive LLC, 4.875%, 15/09/28	153 315	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
158 000 USD	Lamb Weston Holdings Inc, 4.125%, 31/01/30	145 813	0,03	175 000 USD	LifePoint Health Inc, 5.375%, 15/01/29	129 678	0,02
124 000 USD	Lamb Weston Holdings Inc, 4.375%, 31/01/32	113 150	0,02	220 000 USD	LifePoint Health Inc, 9.875%, 15/08/30	222 284	0,04
259 000 USD	Las Vegas Sands Corp, 3.500%, 18/08/26	246 933	0,05	370 000 USD	LifePoint Health Inc, 11.000%, 15/10/30	389 734	0,07
117 000 USD	Las Vegas Sands Corp, 3.900%, 08/08/29	107 803	0,02	166 000 USD	Light & Wonder International Inc, 7.000%, 15/05/28	167 689	0,03
115 000 USD	LBM Acquisition LLC, 6.250%, 15/01/29	102 689	0,02	82 000 USD	Light & Wonder International Inc, 7.250%, 15/11/29	83 961	0,02
246 000 USD	LCM Investments Holdings II LLC, 4.875%, 01/05/29	228 472	0,04	125 000 USD	Light & Wonder International Inc, 7.500%, 01/09/31	130 358	0,02
140 000 USD	LCM Investments Holdings II LLC, 8.250%, 01/08/31	146 119	0,03	150 000 USD	Likewise Corp, 9.750%, 15/10/25	152 064	0,03
154 000 USD	LD Holdings Group LLC, 6.500%, 01/11/25	142 772	0,03	100 000 USD	Lindblad Expeditions Holdings Inc, 9.000%, 15/05/28	103 299	0,02
153 000 USD	LD Holdings Group LLC, 6.125%, 01/04/28	130 444	0,03	100 000 USD	Lindblad Expeditions LLC, 6.750%, 15/02/27	99 500	0,02
200 000 USD	Leeward Renewable Energy Operations LLC, 4.250%, 01/07/29	174 218	0,03	163 000 USD	Lions Gate Capital Holdings LLC, 5.500%, 15/04/29	121 940	0,02
228 000 USD	Legacy LifePoint Health LLC, 4.375%, 15/02/27	210 759	0,04	230 000 USD	Lithia Motors Inc, 4.625%, 15/12/27	221 173	0,04
55 000 USD	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 5.000%, 01/02/26	54 918	0,01	134 000 USD	Lithia Motors Inc, 3.875%, 01/06/29	121 009	0,02
200 000 USD	Level 3 Financing Inc, 3.400%, 01/03/27	186 000	0,04	93 000 USD	Lithia Motors Inc, 4.375%, 15/01/31	84 521	0,02
167 000 USD	Level 3 Financing Inc, 4.625%, 15/09/27	100 200	0,02	100 000 USD	Live Nation Entertainment Inc, 5.625%, 15/03/26	99 086	0,02
298 000 USD	Level 3 Financing Inc, 4.250%, 01/07/28	147 510	0,03	226 000 USD	Live Nation Entertainment Inc, 6.500%, 15/05/27	229 952	0,04
210 000 USD	Level 3 Financing Inc, 3.625%, 15/01/29	88 200	0,02	182 000 USD	Live Nation Entertainment Inc, 4.750%, 15/10/27	174 508	0,03
238 000 USD	Level 3 Financing Inc, 3.750%, 15/07/29	101 150	0,02	280 000 USD	Live Nation Entertainment Inc, 3.750%, 15/01/28	261 126	0,05
200 000 USD	Level 3 Financing Inc, 3.875%, 15/11/29	167 000	0,03	55 000 USD	Louisiana-Pacific Corp, 3.625%, 15/03/29	49 250	0,01
274 000 USD	Level 3 Financing Inc, 10.500%, 15/05/30	265 694	0,05	137 000 USD	LSB Industries Inc, 6.250%, 15/10/28	129 959	0,02
100 000 EUR	Levi Strauss & Co, 3.375%, 15/03/27	108 426	0,02	77 000 USD	LSF11 A5 HoldCo LLC, 6.625%, 15/10/29	65 114	0,01
73 000 USD	Levi Strauss & Co, 3.500%, 01/03/31	63 175	0,01	233 000 USD	LSF9 Atlantis Holdings LLC / Victra Finance Corp, 7.750%, 15/02/26	223 616	0,04
150 000 USD	LFS Topco LLC, 5.875%, 15/10/26	137 782	0,03	100 000 USD	Lumen Technologies Inc, 5.125%, 15/12/26	67 000	0,01
62 000 USD	LGI Homes Inc, 8.750%, 15/12/28	65 953	0,01	400 000 USD	Lumen Technologies Inc, 4.000%, 15/02/27	258 148	0,05
50 000 USD	LGI Homes Inc, 4.000%, 15/07/29	43 125	0,01	117 000 USD	Lumen Technologies Inc, 4.500%, 15/01/29	35 100	0,01
75 000 USD	Liberty Interactive LLC, 8.250%, 01/02/30	31 723	0,01	85 000 USD	Lumen Technologies Inc, 7.600%, 15/09/39	24 106	0,00
200 000 USD	Liberty Mutual Group Inc, 7.800%, 15/03/37	200 011	0,04	80 000 USD	Lumen Technologies Inc, 7.650%, 15/03/42	22 400	0,00
68 000 USD	Liberty Mutual Group Inc, 4.125%, 15/12/51	56 998	0,01	125 000 USD	M/I Homes Inc, 4.950%, 01/02/28	120 259	0,02
100 000 USD	Liberty Mutual Group Inc, 4.300%, 01/02/61	65 587	0,01	100 000 USD	M/I Homes Inc, 3.950%, 15/02/30	89 000	0,02
392 000 USD	Life Time Inc, 5.750%, 15/01/26	389 109	0,07	150 000 USD	Macy's Retail Holdings LLC, 5.875%, 01/04/29	143 936	0,03
175 000 USD	Life Time Inc, 8.000%, 15/04/26	176 660	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 USD	Macy's Retail Holdings LLC, 5.875%, 15/03/30	95 009	0,02	594 000 USD	Medline Borrower LP, 5.250%, 01/10/29	559 769	0,11
100 000 USD	Macy's Retail Holdings LLC, 6.125%, 15/03/32	94 616	0,02	70 000 USD	MercadoLibre Inc, 2.375%, 14/01/26	65 309	0,01
60 000 USD	Macy's Retail Holdings LLC, 4.500%, 15/12/34	48 606	0,01	200 000 USD	MercadoLibre Inc, 3.125%, 14/01/31	171 099	0,03
50 000 USD	Macy's Retail Holdings LLC, 5.125%, 15/01/42	39 000	0,01	40 000 USD	Mercer International Inc, 5.500%, 15/01/26	38 298	0,01
40 000 USD	Macy's Retail Holdings LLC, 4.300%, 15/02/43	29 201	0,01	213 000 USD	Mercer International Inc, 5.125%, 01/02/29	182 959	0,04
122 000 USD	Madison IAQ LLC, 4.125%, 30/06/28	110 986	0,02	16 000 USD	Meritage Homes Corp, 6.000%, 01/06/25	15 957	0,00
207 000 USD	Madison IAQ LLC, 5.875%, 30/06/29	182 441	0,03	115 000 USD	Metis Merger Sub LLC, 6.500%, 15/05/29	103 998	0,02
100 000 USD	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 6.000%, 01/08/26	97 500	0,02	97 000 USD	MGIC Investment Corp, 5.250%, 15/08/28	94 423	0,02
73 000 USD	MajorDrive Holdings IV LLC, 6.375%, 01/06/29	62 963	0,01	126 000 USD	MGM Resorts International, 6.750%, 01/05/25	126 403	0,02
75 000 USD	Manitowoc Co Inc, 9.000%, 01/04/26	75 219	0,01	120 000 USD	MGM Resorts International, 5.750%, 15/06/25	119 544	0,02
55 000 USD	Marriott Ownership Resorts Inc, 4.750%, 15/01/28	50 521	0,01	92 000 USD	MGM Resorts International, 4.625%, 01/09/26	89 784	0,02
161 000 USD	Marriott Ownership Resorts Inc, 4.500%, 15/06/29	141 875	0,03	351 000 USD	MGM Resorts International, 5.500%, 15/04/27	348 212	0,07
163 000 USD	Martin Midstream Partners LP / Martin Midstream Finance Corp, 11.500%, 15/02/28	167 885	0,03	188 000 USD	MGM Resorts International, 4.750%, 15/10/28	179 121	0,03
200 000 USD	Matador Resources Co, 5.875%, 15/09/26	198 501	0,04	236 000 USD	Michaels Cos Inc, 5.250%, 01/05/28	188 894	0,04
135 000 USD	Matador Resources Co, 6.875%, 15/04/28	137 024	0,03	302 000 USD	Michaels Cos Inc, 7.875%, 01/05/29	190 136	0,04
265 000 USD	Match Group Holdings II LLC, 5.000%, 15/12/27	258 892	0,05	120 000 USD	Microstrategy Inc, 6.125%, 15/06/28	116 417	0,02
47 000 USD	Match Group Holdings II LLC, 4.625%, 01/06/28	45 003	0,01	400 000 USD	Midcap Financial Issuer Trust, 6.500%, 01/05/28	375 100	0,07
105 000 USD	Match Group Holdings II LLC, 5.625%, 15/02/29	101 981	0,02	170 000 USD	Midcap Financial Issuer Trust, 5.625%, 15/01/30	147 050	0,03
95 000 USD	Match Group Holdings II LLC, 4.125%, 01/08/30	86 204	0,02	25 000 USD	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance Corp, 5.375%, 15/08/27	24 368	0,00
70 000 USD	Match Group Holdings II LLC, 3.625%, 01/10/31	60 481	0,01	167 000 USD	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 4.875%, 01/05/29	155 310	0,03
140 000 USD	Matthews International Corp, 5.250%, 01/12/25	136 457	0,03	297 000 USD	Millennium Escrow Corp, 6.625%, 01/08/26	210 870	0,04
750 000 USD	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.875%, 15/08/26	763 195	0,15	75 000 USD	Minerals Technologies Inc, 5.000%, 01/07/28	72 127	0,01
300 000 USD	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 9.250%, 15/04/27	294 457	0,06	200 000 USD	MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp, 5.500%, 01/02/30	177 000	0,03
150 000 USD	Maxim Crane Works Holdings Capital LLC, 11.500%, 01/09/28	155 436	0,03	146 000 USD	Mobius Merger Sub Inc, 9.000%, 01/06/30	141 624	0,03
450 000 USD	McAfee Corp, 7.375%, 15/02/30	411 132	0,08	222 000 USD	ModivCare Escrow Issuer Inc, 5.000%, 01/10/29	181 580	0,03
300 000 USD	McGraw-Hill Education Inc, 5.750%, 01/08/28	289 275	0,06	145 000 USD	ModivCare Inc, 5.875%, 15/11/25	143 187	0,03
118 000 USD	McGraw-Hill Education Inc, 8.000%, 01/08/29	109 740	0,02	314 000 USD	Mohegan Tribal Gaming Authority, 8.000%, 01/02/26	296 391	0,06
1 236 000 USD	Medline Borrower LP, 3.875%, 01/04/29	1 117 346	0,21	204 000 USD	Molina Healthcare Inc, 4.375%, 15/06/28	193 020	0,04

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
132 000 USD	Molina Healthcare Inc, 3.875%, 15/11/30	118 615	0,02	73 000 USD	Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5.000%, 01/02/26	71 384	0,01
140 000 USD	Molina Healthcare Inc, 3.875%, 15/05/32	122 378	0,02	115 000 USD	Nationstar Mortgage Holdings Inc, 6.000%, 15/01/27	114 137	0,02
66 000 USD	Moog Inc, 4.250%, 15/12/27	62 321	0,01	166 000 USD	Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5.500%, 15/08/28	159 959	0,03
328 000 USD	Moss Creek Resources Holdings Inc, 7.500%, 15/01/26	327 205	0,06	169 000 USD	Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5.125%, 15/12/30	153 218	0,03
328 000 USD	Moss Creek Resources Holdings Inc, 10.500%, 15/05/27	336 421	0,06	136 000 USD	Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5.750%, 15/11/31	126 820	0,02
346 000 USD	MPH Acquisition Holdings LLC, 5.500%, 01/09/28	309 810	0,06	81 000 USD	Navient Corp, 6.750%, 25/06/25	81 992	0,02
256 000 USD	MPH Acquisition Holdings LLC, 5.750%, 01/11/28	210 200	0,04	116 000 USD	Navient Corp, 6.750%, 15/06/26	117 758	0,02
225 000 EUR	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3.325%, 24/03/25	224 154	0,04	246 000 USD	Navient Corp, 5.000%, 15/03/27	237 476	0,05
150 000 GBP	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 2.500%, 24/03/26	155 095	0,03	268 000 USD	Navient Corp, 4.875%, 15/03/28	248 986	0,05
150 000 USD	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5.250%, 01/08/26	134 051	0,03	204 000 USD	Navient Corp, 5.500%, 15/03/29	188 106	0,04
100 000 EUR	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 0.993%, 15/10/26	82 782	0,02	217 000 USD	Navient Corp, 9.375%, 25/07/30	227 386	0,04
354 000 USD	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5.000%, 15/10/27	289 154	0,06	200 000 USD	Navient Corp, 11.500%, 15/03/31	219 086	0,04
239 000 USD	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4.625%, 01/08/29	171 827	0,03	150 000 USD	Navient Corp, 5.625%, 01/08/33	122 743	0,02
100 000 GBP	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3.375%, 24/04/30	75 494	0,01	125 000 USD	Nbm Us Holdings Inc, 7.000%, perpetual	126 409	0,02
380 000 USD	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3.500%, 15/03/31	237 451	0,05	240 000 USD	NBM US Holdings Inc, 6.625%, 06/08/29	235 279	0,05
75 000 USD	Mueller Water Products Inc, 4.000%, 15/06/29	68 325	0,01	350 000 USD	NCL Corp LTD, 5.875%, 15/02/27	347 021	0,07
97 000 USD	Murphy Oil Corp, 5.875%, 01/12/27	96 531	0,02	105 000 USD	NCL Corp LTD, 7.750%, perpetual	105 496	0,02
102 000 USD	Murphy Oil Corp, 6.375%, 15/07/28	102 568	0,02	350 000 USD	NCR Atleos Corp, 9.500%, 01/04/29	371 874	0,07
100 000 USD	Murphy Oil Corp, 5.875%, 01/12/42	88 095	0,02	200 000 USD	NCR Voyix Corp, 5.000%, 01/10/28	189 143	0,04
50 000 USD	Murphy Oil USA Inc, 5.625%, 01/05/27	49 564	0,01	298 000 USD	NCR Voyix Corp, 5.125%, 15/04/29	283 248	0,05
71 000 USD	Murphy Oil USA Inc, 4.750%, 15/09/29	67 273	0,01	75 000 USD	NCR Voyix Corp, 5.250%, 01/10/30	68 859	0,01
75 000 USD	Murphy Oil USA Inc, 3.750%, 15/02/31	65 258	0,01	118 000 USD	Necessity Retail REIT Inc / American Finance Operating Partner LP, 4.500%, 30/09/28	99 365	0,02
86 000 USD	Nabors Industries Inc, 5.750%, 01/02/25	85 971	0,02	833 000 USD	Neptune Bidco US Inc, 9.290%, 15/04/29	776 572	0,15
200 000 USD	Nabors Industries Inc, 7.375%, 15/05/27	195 937	0,04	264 000 USD	NESCO Holdings II Inc, 5.500%, 15/04/29	244 092	0,05
166 667 USD	Nabors Industries Inc, 9.125%, 31/01/30	167 344	0,03	200 000 USD	New Enterprise Stone & Lime Co Inc, 5.250%, 15/07/28	190 782	0,04
				444 000 USD	New Fortress Energy Inc, 6.750%, 15/09/25	440 256	0,08
				445 000 USD	New Fortress Energy Inc, 6.500%, 30/09/26	427 295	0,08
				75 000 USD	Newell Brands Inc, 4.875%, 01/06/25	73 760	0,01
				600 000 USD	Newell Brands Inc, 5.200%, 01/04/26	591 918	0,11
				127 000 USD	Newell Brands Inc, 6.375%, 15/09/27	126 294	0,02
				86 000 USD	Newell Brands Inc, 6.625%, 15/09/29	85 670	0,02
				70 000 USD	Newell Brands Inc, 6.375%, 01/04/36	64 035	0,01
				155 000 USD	Newell Brands Inc, 6.500%, 01/04/46	129 024	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
198 000 USD	Newfold Digital Holdings Group Inc, 11.750%, 15/10/28	212 998	0,04	136 000 USD	Novelis Corp, 3.875%, 15/08/31	119 847	0,02
100 000 USD	Newfold Digital Holdings Group Inc, 6.000%, 15/02/29	75 547	0,01	30 000 USD	NRG Energy Inc, 6.625%, 15/01/27	30 060	0,01
250 000 USD	News Corp, 3.875%, 15/05/29	229 976	0,04	234 000 USD	NRG Energy Inc, 5.750%, 15/01/28	233 129	0,04
100 000 USD	News Corp, 5.125%, 15/02/32	94 974	0,02	168 000 USD	NRG Energy Inc, 3.375%, 15/02/29	148 480	0,03
486 000 USD	Nexstar Media Inc, 5.625%, 15/07/27	469 891	0,09	266 000 USD	NRG Energy Inc, 5.250%, 15/06/29	257 544	0,05
234 000 USD	Nexstar Media Inc, 4.750%, 01/11/28	215 638	0,04	272 000 USD	NRG Energy Inc, 3.625%, 15/02/31	233 713	0,04
327 000 USD	NextEra Energy Operating Partners LP, 3.875%, 15/10/26	311 626	0,06	244 000 USD	NRG Energy Inc, 3.875%, 15/02/32	208 876	0,04
143 000 USD	NextEra Energy Operating Partners LP, 4.500%, 15/09/27	137 638	0,03	100 000 USD	NuStar Logistics LP, 5.750%, 01/10/25	99 250	0,02
202 000 USD	NextEra Energy Operating Partners LP, 7.250%, 15/01/29	211 267	0,04	145 000 USD	NuStar Logistics LP, 6.000%, 01/06/26	144 745	0,03
100 000 USD	NFP Corp, 4.875%, 15/08/28	98 971	0,02	120 000 USD	NuStar Logistics LP, 5.625%, 28/04/27	119 489	0,02
546 000 USD	NFP Corp, 6.875%, 15/08/28	554 941	0,11	198 000 USD	NuStar Logistics LP, 6.375%, 01/10/30	198 350	0,04
67 000 USD	NFP Corp, 7.500%, 01/10/30	71 249	0,01	175 000 USD	Oceaneering International Inc, 6.000%, 01/02/28	169 624	0,03
478 000 USD	NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp, 7.500%, 01/02/26	482 801	0,09	150 000 USD	Office Properties Income Trust, 4.500%, 01/02/25	117 665	0,02
75 000 USD	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp, 6.125%, 01/03/25	74 514	0,01	140 000 USD	Office Properties Income Trust, 2.650%, 15/06/26	86 829	0,02
305 000 USD	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp, 7.500%, 15/04/26	303 350	0,06	100 000 USD	Office Properties Income Trust, 2.400%, 01/02/27	56 041	0,01
100 000 USD	Nine Energy Service Inc, 13.000%, 01/02/28	88 250	0,02	200 000 USD	Office Properties Income Trust, 3.450%, 15/10/31	99 576	0,02
278 000 USD	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC, 7.125%, perpetual	267 303	0,05	130 000 USD	Olin Corp, 5.125%, 15/09/27	126 860	0,02
170 000 USD	NMI Holdings Inc, 7.375%, 01/06/25	170 282	0,03	175 000 USD	Olin Corp, 5.625%, 01/08/29	172 217	0,03
150 000 USD	Noble Finance II LLC, 8.000%, 15/04/30	156 531	0,03	125 000 USD	Olin Corp, 5.000%, 01/02/30	119 222	0,02
50 000 USD	Nordstrom Inc, 4.000%, 15/03/27	46 577	0,01	73 000 USD	Olympus Water US Holding Corp, 7.125%, 01/10/27	73 082	0,01
100 000 USD	Nordstrom Inc, 6.950%, 15/03/28	101 500	0,02	100 000 EUR	Olympus Water US Holding Corp, 3.875%, 01/10/28	100 767	0,02
85 000 USD	Nordstrom Inc, 4.375%, 01/04/30	73 939	0,01	133 000 USD	Olympus Water US Holding Corp, 4.250%, 01/10/28	119 653	0,02
160 000 USD	Nordstrom Inc, 4.250%, 01/08/31	133 117	0,03	150 000 EUR	Olympus Water US Holding Corp, 9.625%, 15/11/28	177 296	0,03
200 000 USD	Nordstrom Inc, 5.000%, 15/01/44	142 688	0,03	600 000 USD	Olympus Water US Holding Corp, 9.750%, 15/11/28	636 484	0,12
338 000 USD	Northern Oil and Gas Inc, 8.125%, 01/03/28	342 225	0,07	100 000 EUR	Olympus Water US Holding Corp, 5.375%, 01/10/29	93 837	0,02
175 000 USD	Northern Oil and Gas Inc, 8.750%, 15/06/31	182 071	0,03	50 000 USD	Olympus Water US Holding Corp, 6.250%, 01/10/29	44 392	0,01
20 000 USD	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc, 4.750%, 30/04/27	19 100	0,00	107 000 USD	ON Semiconductor Corp, 3.875%, 01/09/28	99 245	0,02
100 000 USD	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc, 6.000%, 15/02/28	92 452	0,02	250 000 USD	OneMain Finance Corp, 6.875%, 15/03/25	253 070	0,05
140 000 USD	Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc, 10.750%, 01/06/28	140 969	0,03	413 000 USD	OneMain Finance Corp, 7.125%, 15/03/26	420 811	0,08
245 000 USD	Novelis Corp, 3.250%, 15/11/26	230 620	0,04	378 000 USD	OneMain Finance Corp, 3.500%, 15/01/27	349 819	0,07
346 000 USD	Novelis Corp, 4.750%, 30/01/30	325 405	0,06				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
138 000 USD	OneMain Finance Corp, 6.625%, 15/01/28	139 336	0,03	200 000 USD	Oxford Finance LLC / Oxford Finance Co-Issuer II Inc, 6.375%, 01/02/27	188 849	0,04
144 000 USD	OneMain Finance Corp, 3.875%, 15/09/28	127 423	0,02	70 000 USD	P&L Development LLC / PLD Finance Corp, 7.750%, 15/11/25	56 875	0,01
222 000 USD	OneMain Finance Corp, 9.000%, 15/01/29	234 832	0,04	50 000 USD	Pacific Western Bank, 3.250%, 01/05/31	42 964	0,01
168 000 USD	OneMain Finance Corp, 5.375%, 15/11/29	157 492	0,03	260 000 USD	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 4.000%, 15/10/27	242 738	0,05
275 000 USD	OneMain Finance Corp, 7.875%, 15/03/30	283 111	0,05	72 000 USD	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC / Pactiv Evergreen Group Issuer Inc, 4.375%, perpetual	67 081	0,01
232 000 USD	OneMain Finance Corp, 4.000%, 15/09/30	198 497	0,04	80 000 USD	Papa John's International Inc, 3.875%, 15/09/29	70 789	0,01
222 000 USD	Open Text Holdings Inc, 4.125%, 15/02/30	200 917	0,04	193 000 USD	Paramount Global, 6.250%, 28/02/57	169 033	0,03
155 000 USD	Open Text Holdings Inc, 4.125%, 01/12/31	137 055	0,03	300 000 USD	Paramount Global, 6.375%, 30/03/62	270 000	0,05
31 000 USD	OPENLANE Inc, 5.125%, 01/06/25	30 458	0,01	93 000 USD	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer, 7.500%, 01/06/25	93 527	0,02
66 000 USD	Option Care Health Inc, 4.375%, 31/10/29	59 654	0,01	209 000 USD	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer, 5.875%, 01/10/28	205 547	0,04
300 000 EUR	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 2.875%, 30/04/28	303 956	0,06	184 000 USD	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer, 4.875%, 15/05/29	170 193	0,03
700 000 USD	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 4.125%, 30/04/28	644 497	0,12	170 000 USD	Park River Holdings Inc, 5.625%, 01/02/29	135 812	0,03
520 000 USD	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 5.125%, 30/04/31	444 620	0,08	50 000 USD	Park River Holdings Inc, 6.750%, 01/08/29	40 802	0,01
75 000 USD	Osaic Holdings Inc, 10.750%, 01/08/27	76 125	0,01	150 000 USD	Park-Ohio Industries Inc, 6.625%, 15/04/27	138 750	0,03
200 000 USD	Oscar AcquisitionCo LLC / Oscar Finance Inc, 9.500%, 15/04/30	195 000	0,04	50 000 USD	Patrick Industries Inc, 7.500%, 15/10/27	50 125	0,01
50 000 USD	OT Merger Corp, 7.875%, 15/10/29	29 950	0,01	45 000 USD	Patrick Industries Inc, 4.750%, 01/05/29	40 978	0,01
83 000 USD	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp, 5.000%, 15/08/27	80 308	0,02	299 000 USD	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc, 4.500%, 15/08/28	282 812	0,05
235 000 USD	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp, 4.250%, 15/01/29	212 057	0,04	71 000 USD	Patterson-UTI Energy Inc, 3.950%, 01/02/28	66 189	0,01
63 000 USD	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp, 4.625%, 15/03/30	56 201	0,01	50 000 USD	Patterson-UTI Energy Inc, 5.150%, 15/11/29	47 810	0,01
100 000 USD	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp, 7.375%, 15/02/31	105 155	0,02	50 000 USD	Paysafe Finance PLC / Paysafe Holdings US Corp, 4.000%, 15/06/29	44 174	0,01
141 000 USD	Owens & Minor Inc, 4.500%, 31/03/29	124 372	0,02	238 000 USD	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp, 6.000%, 15/02/28	231 104	0,04
185 000 USD	Owens & Minor Inc, 6.625%, 01/04/30	177 403	0,03	150 000 USD	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp, 7.875%, 15/09/30	152 760	0,03
125 000 USD	Owens-Brockway Glass Container Inc, 6.375%, 15/08/25	125 311	0,02	180 000 USD	PECF USS Intermediate Holding III Corp, 8.000%, 15/11/29	91 800	0,02
113 000 USD	Owens-Brockway Glass Container Inc, 6.625%, 13/05/27	113 005	0,02	150 000 USD	Pediatrix Medical Group Inc, 5.375%, 15/02/30	133 514	0,03
175 000 USD	Owens-Brockway Glass Container Inc, 7.250%, 15/05/31	177 431	0,03				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
155 000	USD Penn Entertainment Inc, 5.625%, 15/01/27	150 397	0,03	130 000	USD Pitney Bowes Inc, 6.875%, 15/03/27	121 413	0,02
60 000	USD Penn Entertainment Inc, 4.125%, 01/07/29	51 483	0,01	50 000	USD Pitney Bowes Inc, 7.250%, 15/03/29	42 813	0,01
124 000	USD PennyMac Financial Services Inc, 5.375%, 15/10/25	122 546	0,02	193 000	USD Playtika Holding Corp, 4.250%, 15/03/29	168 402	0,03
153 000	USD PennyMac Financial Services Inc, 4.250%, 15/02/29	137 716	0,03	279 000	USD PM General Purchaser LLC, 9.500%, 01/10/28	282 939	0,05
68 000	USD PennyMac Financial Services Inc, 7.875%, 15/12/29	70 006	0,01	25 000	USD Polar US Borrower LLC / Schenectady International Group Inc, 6.750%, 15/05/26	8 000	0,00
147 000	USD PennyMac Financial Services Inc, 5.750%, 15/09/31	136 112	0,03	36 000	USD Post Holdings Inc, 5.750%, 01/03/27	35 743	0,01
138 000	USD Penske Automotive Group Inc, 3.500%, 01/09/25	133 890	0,03	301 000	USD Post Holdings Inc, 5.625%, 15/01/28	298 305	0,06
121 000	USD Penske Automotive Group Inc, 3.750%, 15/06/29	107 518	0,02	316 000	USD Post Holdings Inc, 5.500%, 15/12/29	304 527	0,06
40 000	USD Performance Food Group Inc, 6.875%, 01/05/25	40 152	0,01	245 000	USD Post Holdings Inc, 4.625%, 15/04/30	225 400	0,04
240 000	USD Performance Food Group Inc, 5.500%, 15/10/27	236 491	0,05	193 000	USD Post Holdings Inc, 4.500%, 15/09/31	173 073	0,03
252 000	USD Performance Food Group Inc, 4.250%, 01/08/29	231 175	0,04	40 000	USD PRA Group Inc, 7.375%, 01/09/25	39 602	0,01
400 000	USD Periana Holdings LLC, 5.950%, 19/04/26	393 456	0,08	150 000	USD PRA Group Inc, 8.375%, 01/02/28	144 407	0,03
50 000	USD Permian Resources Operating LLC, 5.375%, 15/01/26	49 331	0,01	74 000	USD PRA Group Inc, 5.000%, 01/10/29	61 027	0,01
75 000	USD Permian Resources Operating LLC, 7.750%, 15/02/26	76 312	0,01	120 000	USD PRA Health Sciences Inc, 2.875%, 15/07/26	112 537	0,02
95 000	USD Permian Resources Operating LLC, 6.875%, 01/04/27	94 953	0,02	207 000	USD Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp, 5.625%, 01/09/29	164 156	0,03
100 000	USD Permian Resources Operating LLC, 8.000%, 15/04/27	103 549	0,02	195 000	USD Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp, 5.875%, 01/09/31	150 790	0,03
166 000	USD Permian Resources Operating LLC, 5.875%, 01/07/29	161 841	0,03	145 000	USD Presidio Holdings Inc, 4.875%, 01/02/27	142 143	0,03
150 000	USD Permian Resources Operating LLC, 9.875%, 15/07/31	166 687	0,03	140 000	USD Presidio Holdings Inc, 8.250%, 01/02/28	141 442	0,03
190 000	USD Permian Resources Operating LLC, 7.000%, 15/01/32	195 836	0,04	75 000	USD Prestige Brands Inc, 5.125%, 15/01/28	72 835	0,01
450 000	USD PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 4.750%, 15/02/28	424 548	0,08	87 000	USD Prestige Brands Inc, 3.750%, 01/04/31	76 237	0,01
415 000	USD PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 7.750%, 15/02/29	403 628	0,08	242 000	USD Prime Healthcare Services Inc, 7.250%, 01/11/25	235 950	0,05
74 000	USD Pgt Innovations Inc, 4.375%, 01/10/29	73 762	0,01	361 000	USD Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 5.750%, 15/04/26	362 549	0,07
180 000	USD PHH Mortgage Corp, 7.875%, 15/03/26	161 208	0,03	165 000	USD Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 3.375%, 31/08/27	152 928	0,03
275 000	USD Pike Corp, 5.500%, 01/09/28	261 992	0,05	325 000	USD Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 6.250%, 15/01/28	323 378	0,06
100 000	USD Pike Corp, 8.625%, 31/01/31	105 093	0,02	200 000	EUR Primo Water Holdings Inc, 3.875%, 31/10/28	212 753	0,04
200 000	USD Pilgrim's Pride Corp, 4.250%, 15/04/31	180 644	0,03	121 000	USD Primo Water Holdings Inc, 4.375%, 30/04/29	111 489	0,02
200 000	USD Pilgrim's Pride Corp, 3.500%, 01/03/32	169 084	0,03	200 000	USD PROG Holdings Inc, 6.000%, 15/11/29	184 306	0,04
400 000	USD Pilgrim's Pride Corp, 6.250%, 01/07/33	411 613	0,08	66 000	USD PTC Inc, 3.625%, 15/02/25	64 558	0,01
100 000	USD Pilgrim's Pride Corp, 6.875%, 15/05/34	108 008	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
163 000	USD PTC Inc, 4.000%, 15/02/28	154 473	0,03	100 000	USD RingCentral Inc, 8.500%, 15/08/30	102 250	0,02
150 000	USD QVC Inc, 4.450%, 15/02/25	140 788	0,03	187 550	USD Rio Oil Finance Trust Series 2018-1, 8.200%, 06/04/28	191 301	0,04
174 000	USD QVC Inc, 4.750%, 15/02/27	137 733	0,03	125 000	USD Ritchie Bros Holdings Inc, 6.750%, 15/03/28	128 697	0,02
126 000	USD QVC Inc, 4.375%, 01/09/28	90 970	0,02	180 000	USD Ritchie Bros Holdings Inc, 7.750%, 15/03/31	191 900	0,04
120 000	USD QVC Inc, 5.450%, 15/08/34	72 720	0,01	224 000	USD Rithm Capital Corp, 6.250%, 15/10/25	220 483	0,04
40 000	USD Qwest Corp, 7.250%, 15/09/25	39 200	0,01	166 000	USD RLJ Lodging Trust LP, 3.750%, 01/07/26	157 284	0,03
172 000	USD Rackspace Technology Global Inc, 3.500%, 15/02/28	69 076	0,01	86 000	USD RLJ Lodging Trust LP, 4.000%, 15/09/29	77 282	0,01
160 000	USD Rackspace Technology Global Inc, 5.375%, 01/12/28	57 650	0,01	214 000	USD ROBLOX Corp, 3.875%, 01/05/30	190 839	0,04
228 000	USD Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc, 4.500%, 15/09/26	173 896	0,03	247 000	USD Rockcliff Energy II LLC, 5.500%, 15/10/29	233 440	0,04
215 000	USD Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc, 6.500%, 15/09/28	105 347	0,02	233 000	USD Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 2.875%, 15/10/26	214 942	0,04
254 000	USD Radiology Partners Inc, 9.250%, 01/02/28	130 061	0,02	155 000	USD Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3.625%, 01/03/29	140 287	0,03
156 000	USD Railworks Holdings LP / Railworks Rally Inc, 8.250%, 15/11/28	154 440	0,03	212 000	USD Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3.875%, 01/03/31	186 332	0,04
200 000	USD Rain Carbon Inc, 12.250%, 01/09/29	195 500	0,04	150 000	USD Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 4.000%, 15/10/33	127 529	0,02
158 000	USD Raising Cane's Restaurants LLC, 9.375%, 01/05/29	168 623	0,03	177 000	USD Rocket Software Inc, 6.500%, 15/02/29	153 990	0,03
250 000	USD Rand Parent LLC, 8.500%, 15/02/30	239 390	0,05	75 000	USD Rockies Express Pipeline LLC, 3.600%, 15/05/25	72 579	0,01
200 000	USD Range Resources Corp, 4.875%, 15/05/25	197 532	0,04	137 000	USD Rockies Express Pipeline LLC, 4.950%, 15/07/29	130 889	0,03
99 000	USD Range Resources Corp, 8.250%, 15/01/29	102 424	0,02	70 000	USD Rockies Express Pipeline LLC, 4.800%, 15/05/30	64 050	0,01
122 000	USD Range Resources Corp, 4.750%, 15/02/30	112 776	0,02	150 000	USD Rockies Express Pipeline LLC, 7.500%, 15/07/38	151 429	0,03
140 000	USD Raptor Acquisition Corp / Raptor Co-Issuer LLC, 4.875%, 01/11/26	133 276	0,03	285 000	USD Rockies Express Pipeline LLC, 6.875%, 15/04/40	279 820	0,05
129 000	USD Rayonier AM Products Inc, 7.625%, 15/01/26	118 357	0,02	74 000	USD Roller Bearing Co of America Inc, 4.375%, 15/10/29	68 482	0,01
142 000	USD Real Hero Merger Sub 2 Inc, 6.250%, 01/02/29	122 423	0,02	176 000	USD Royal Caribbean Cruises Ltd, 4.250%, 01/07/26	169 948	0,03
264 000	USD Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 5.750%, 15/01/29	205 243	0,04	68 000	USD Royal Caribbean Cruises Ltd, 3.700%, 15/03/28	62 682	0,01
268 000	USD Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 5.250%, 15/04/30	200 083	0,04	180 000	USD RP Escrow Issuer LLC, 5.250%, 15/12/25	144 017	0,03
348 000	USD RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc, 9.750%, 01/12/26	345 876	0,07	75 000	USD RR Donnelley & Sons Co, 9.750%, 31/07/28	74 531	0,01
50 000	USD Resideo Funding Inc, 4.000%, 01/09/29	43 625	0,01	65 000	USD Ryan Specialty LLC, 4.375%, 01/02/30	60 288	0,01
265 000	USD Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc, 4.625%, 16/04/29	230 937	0,04	225 000	USD Sabre Global Inc, 8.625%, 01/06/27	204 373	0,04
160 000	USD Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc, 4.625%, 06/04/31	130 644	0,03	230 000	USD Sabre Global Inc, 11.250%, 15/12/27	225 982	0,04
186 000	USD RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp, 4.750%, 15/10/27	179 655	0,03	100 000	USD Safeway Inc, 7.250%, 01/02/31	104 371	0,02
66 000	USD RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp, 7.250%, 15/07/28	68 619	0,01				
128 000	USD RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp, 4.500%, 15/02/29	119 045	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
100 000 USD	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5.625%, 01/12/25	100 015	0,02	73 000 USD	Sensata Technologies Inc, 4.375%, 15/02/30	67 707	0,01
100 000 USD	Sasol Financing USA LLC, 4.375%, 18/09/26	92 869	0,02	251 000 USD	Sensata Technologies Inc, 3.750%, 15/02/31	221 077	0,04
450 000 USD	Sasol Financing USA LLC, 8.750%, 03/05/29	458 832	0,09	74 000 USD	Service Corp International/US, 4.625%, 15/12/27	71 595	0,01
400 000 USD	Sasol Financing USA LLC, 5.500%, 18/03/31	336 707	0,06	372 000 USD	Service Corp International/US, 5.125%, 01/06/29	364 560	0,07
200 000 USD	SASOL Financing USA LLC, 6.500%, 27/09/28	190 511	0,04	202 000 USD	Service Corp International/US, 3.375%, 15/08/30	176 044	0,03
347 000 USD	SBA Communications Corp, 3.875%, 15/02/27	333 326	0,06	180 000 USD	Service Corp International/US, 4.000%, 15/05/31	161 190	0,03
279 000 USD	SBA Communications Corp, 3.125%, 01/02/29	250 724	0,05	65 000 USD	Service Properties Trust, 4.500%, 15/03/25	63 456	0,01
55 000 USD	Science Applications International Corp, 4.875%, 01/04/28	52 388	0,01	132 000 USD	Service Properties Trust, 7.500%, 15/09/25	133 499	0,03
322 000 USD	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc, 6.625%, 01/03/30	304 428	0,06	100 000 USD	Service Properties Trust, 5.250%, 15/02/26	97 080	0,02
324 000 USD	SCIH Salt Holdings Inc, 4.875%, 01/05/28	303 226	0,06	120 000 USD	Service Properties Trust, 4.750%, 01/10/26	111 985	0,02
186 000 USD	SCIH Salt Holdings Inc, 6.625%, 01/05/29	173 704	0,03	250 000 USD	Service Properties Trust, 4.950%, 15/02/27	226 284	0,04
100 000 EUR	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC, 4.375%, 01/11/26	107 151	0,02	165 000 USD	Service Properties Trust, 5.500%, 15/12/27	151 053	0,03
200 000 USD	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC, 5.375%, 01/11/26	191 986	0,04	225 000 USD	Service Properties Trust, 3.950%, 15/01/28	184 290	0,04
100 000 EUR	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC, 9.500%, 15/07/28	117 645	0,02	200 000 USD	Service Properties Trust, 4.950%, 01/10/29	165 526	0,03
75 000 USD	Scotts Miracle-Gro Co, 4.500%, 15/10/29	66 751	0,01	200 000 USD	Service Properties Trust, 4.375%, 15/02/30	155 263	0,03
168 000 USD	Scotts Miracle-Gro Co, 4.000%, 01/04/31	142 749	0,03	263 000 USD	Service Properties Trust, 8.625%, 15/11/31	275 533	0,05
150 000 USD	Scotts Miracle-Gro Co, 4.375%, 01/02/32	127 123	0,02	100 000 USD	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp, 4.750%, 15/02/28	94 000	0,02
93 000 USD	Scripps Escrow II Inc, 3.875%, 15/01/29	82 252	0,02	100 000 USD	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp, 4.750%, 01/04/29	92 000	0,02
115 000 USD	Scripps Escrow II Inc, 5.375%, 15/01/31	84 399	0,02	200 000 USD	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 4.625%, 01/11/26	194 482	0,04
163 000 USD	Scripps Escrow Inc, 5.875%, 15/07/27	144 814	0,03	30 609 USD	Shutterfly Finance LLC, 8.500%, 01/10/27	21 897	0,00
125 000 USD	Sealed Air Corp, 5.500%, 15/09/25	125 000	0,02	200 000 USD	SierraCol Energy Andina LLC, 6.000%, 15/06/28	168 290	0,03
105 000 USD	Sealed Air Corp, 4.000%, 01/12/27	98 510	0,02	25 000 USD	Signal Parent Inc, 6.125%, 01/04/29	17 875	0,00
70 000 USD	Sealed Air Corp, 5.000%, 15/04/29	67 349	0,01	200 000 EUR	Silgan Holdings Inc, 3.250%, 15/03/25	218 722	0,04
145 000 USD	Sealed Air Corp, 6.875%, 15/07/33	153 785	0,03	152 000 USD	Silgan Holdings Inc, 4.125%, 01/02/28	145 166	0,03
297 000 USD	Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 6.125%, 01/02/28	299 448	0,06	100 000 EUR	Silgan Holdings Inc, 2.250%, 01/06/28	101 226	0,02
83 000 USD	Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 7.250%, 15/02/31	88 005	0,02	303 000 USD	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 4.625%, 01/03/29	262 378	0,05
130 000 USD	SeaWorld Parks & Entertainment Inc, 5.250%, 15/08/29	121 360	0,02	50 000 USD	Sinclair Television Group Inc, 5.125%, 15/02/27	44 625	0,01
308 000 USD	Select Medical Corp, 6.250%, 15/08/26	309 620	0,06				
200 000 USD	Sensata Technologies BV, 4.000%, 15/04/29	185 881	0,04				
44 000 USD	Sensata Technologies BV, 5.875%, 01/09/30	43 707	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
197 000 USD	Sinclair Television Group Inc, 5.500%, 01/03/30	147 774	0,03	202 000 USD	Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp, 6.375%, 30/09/26	198 113	0,04
167 000 USD	Sinclair Television Group Inc, 4.125%, 01/12/30	117 735	0,02	100 000 EUR	Spectrum Brands Inc, 4.000%, 01/10/26	108 740	0,02
136 000 USD	Sirius XM Radio Inc, 3.125%, 01/09/26	127 843	0,02	125 000 USD	Spectrum Brands Inc, 5.500%, 15/07/30	121 296	0,02
499 000 USD	Sirius XM Radio Inc, 5.000%, 01/08/27	481 691	0,09	163 000 USD	Spectrum Brands Inc, 3.875%, 15/03/31	148 451	0,03
488 000 USD	Sirius XM Radio Inc, 4.000%, 15/07/28	451 004	0,09	160 000 USD	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 4.875%, 01/11/27	150 197	0,03
252 000 USD	Sirius XM Radio Inc, 5.500%, 01/07/29	243 641	0,05	100 000 USD	Spirit AeroSystems Inc, 3.850%, 15/06/26	96 097	0,02
330 000 USD	Sirius XM Radio Inc, 4.125%, 01/07/30	293 626	0,06	115 000 USD	Spirit AeroSystems Inc, 4.600%, 15/06/28	101 711	0,02
361 000 USD	Sirius XM Radio Inc, 3.875%, 01/09/31	308 824	0,06	325 000 USD	Spirit AeroSystems Inc, 9.375%, 30/11/29	355 570	0,07
158 000 USD	Sitio Royalties Operating Partnership LP / Sitio Finance Corp, 7.875%, 01/11/28	163 723	0,03	300 000 USD	Spirit AeroSystems Inc, 9.750%, 15/11/30	322 591	0,06
270 000 USD	Six Flags Entertainment Corp, 5.500%, 15/04/27	263 943	0,05	100 000 USD	SPX FLOW Inc, 8.750%, 01/04/30	100 000	0,02
100 000 USD	Six Flags Entertainment Corp, 7.250%, 15/05/31	100 308	0,02	70 000 USD	SRS Distribution Inc, 4.625%, 01/07/28	66 409	0,01
109 000 USD	Six Flags Theme Parks Inc, 7.000%, 01/07/25	109 472	0,02	100 000 USD	SRS Distribution Inc, 6.125%, 01/07/29	94 803	0,02
95 000 USD	Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 8.500%, 28/11/25	94 765	0,02	140 000 USD	SRS Distribution Inc, 6.000%, 01/12/29	130 537	0,03
163 000 USD	SLM Corp, 4.200%, 29/10/25	158 110	0,03	496 000 USD	SS&C Technologies Inc, 5.500%, 30/09/27	488 754	0,09
80 000 USD	SLM Corp, 3.125%, 02/11/26	74 595	0,01	292 000 USD	Stagwell Global LLC, 5.625%, 15/08/29	268 601	0,05
70 000 USD	SM Energy Co, 5.625%, 01/06/25	68 964	0,01	200 000 EUR	Standard Industries Inc/NJ, 2.250%, 21/11/26	208 227	0,04
170 000 USD	SM Energy Co, 6.750%, 15/09/26	169 454	0,03	304 000 USD	Standard Industries Inc/NJ, 5.000%, 15/02/27	296 349	0,06
250 000 USD	SM Energy Co, 6.625%, 15/01/27	248 244	0,05	345 000 USD	Standard Industries Inc/NJ, 4.750%, 15/01/28	332 265	0,06
105 000 USD	SM Energy Co, 6.500%, 15/07/28	105 048	0,02	442 000 USD	Standard Industries Inc/NJ, 4.375%, 15/07/30	406 722	0,08
296 000 USD	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 6.000%, 01/11/28	291 455	0,06	174 000 USD	Standard Industries Inc/NJ, 3.375%, 15/01/31	149 673	0,03
304 000 USD	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 8.875%, 15/11/31	319 599	0,06	628 000 USD	Staples Inc, 7.500%, 15/04/26	584 204	0,11
300 000 USD	Solaris Midstream Holdings LLC, 7.625%, 01/04/26	304 172	0,06	310 000 USD	Staples Inc, 10.750%, 15/04/27	225 938	0,04
104 000 USD	Sonic Automotive Inc, 4.625%, 15/11/29	94 747	0,02	267 000 USD	Star Parent Inc, 9.000%, 01/10/30	281 403	0,05
113 000 USD	Sonic Automotive Inc, 4.875%, 15/11/31	100 725	0,02	75 000 USD	Starwood Property Trust Inc, 4.750%, 15/03/25	74 003	0,01
325 000 USD	Sotheby's, 7.375%, 15/10/27	313 336	0,06	100 000 USD	Starwood Property Trust Inc, 3.625%, 15/07/26	94 728	0,02
270 000 USD	Sotheby's/Bidfair Holdings Inc, 5.875%, 01/06/29	235 823	0,05	150 000 USD	Starwood Property Trust Inc, 4.375%, 15/01/27	141 364	0,03
65 000 USD	Southwestern Energy Co, 5.700%, 23/01/25	64 729	0,01	92 000 USD	Station Casinos LLC, 4.500%, 15/02/28	86 665	0,02
215 000 USD	Southwestern Energy Co, 5.375%, 01/02/29	209 832	0,04	110 000 USD	Station Casinos LLC, 4.625%, 01/12/31	99 184	0,02
288 000 USD	Southwestern Energy Co, 5.375%, 15/03/30	281 457	0,05	160 000 USD	Steelcase Inc, 5.125%, 18/01/29	151 646	0,03
270 000 USD	Southwestern Energy Co, 4.750%, 01/02/32	249 833	0,05	170 000 USD	Stericycle Inc, 3.875%, 15/01/29	154 253	0,03
125 000 USD	Spanish Broadcasting System Inc, 9.750%, 01/03/26	72 500	0,01				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
200 000	USD Stillwater Mining Co, 4.000%, 16/11/26	177 500	0,03	232 000	USD Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 5.500%, 15/01/28	219 242	0,04
160 000	USD StoneMor Inc, 8.500%, 15/05/29	125 600	0,02	330 000	USD Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 6.000%, 31/12/30	306 807	0,06
95 000	USD StoneX Group Inc, 8.625%, 15/06/25	95 971	0,02	180 000	USD Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 6.000%, 01/09/31	166 280	0,03
100 000	USD Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5.875%, 01/03/27	99 542	0,02	178 000	USD Talos Production Inc, 12.000%, 15/01/26	183 117	0,04
104 000	USD Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5.000%, 01/06/31	95 066	0,02	100 000	USD Taylor Morrison Communities Inc, 5.875%, 15/06/27	100 500	0,02
45 000	USD Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp, 5.875%, 15/05/25	44 634	0,01	125 000	USD Taylor Morrison Communities Inc, 5.750%, 15/01/28	125 436	0,02
140 000	USD Summer BC Bidco B LLC, 5.500%, 31/10/26	131 040	0,03	93 000	USD Taylor Morrison Communities Inc, 5.125%, 01/08/30	89 966	0,02
50 000	USD Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 6.500%, 15/03/27	49 967	0,01	379 000	USD Team Health Holdings Inc, 6.375%, 01/02/25	317 412	0,06
116 000	USD Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 5.250%, 15/01/29	112 230	0,02	145 000	USD TEGNA Inc, 4.750%, 15/03/26	141 121	0,03
168 000	USD Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 7.250%, 15/01/31	176 797	0,03	196 000	USD TEGNA Inc, 4.625%, 15/03/28	183 078	0,04
230 000	USD Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 9.000%, 15/10/26	229 508	0,04	370 000	USD TEGNA Inc, 5.000%, 15/09/29	338 998	0,06
195 000	USD SunCoke Energy Inc, 4.875%, 30/06/29	175 493	0,03	236 000	USD Teleflex Inc, 4.625%, 15/11/27	230 461	0,04
200 000	USD Sunnova Energy Corp, 5.875%, 01/09/26	170 252	0,03	82 000	USD Teleflex Inc, 4.250%, 01/06/28	77 764	0,01
213 000	USD Sunnova Energy Corp, 11.750%, 01/10/28	193 181	0,04	25 000	USD Tempo Acquisition LLC / Tempo Acquisition Finance Corp, 5.750%, 01/06/25	25 047	0,00
167 000	USD Sunoco LP / Sunoco Finance Corp, 5.875%, 15/03/28	166 793	0,03	169 000	USD Tempur Sealy International Inc, 4.000%, 15/04/29	152 603	0,03
150 000	USD Sunoco LP / Sunoco Finance Corp, 7.000%, 15/09/28	154 724	0,03	130 000	USD Tempur Sealy International Inc, 3.875%, 15/10/31	109 919	0,02
175 000	USD Sunoco LP / Sunoco Finance Corp, 4.500%, 15/05/29	162 444	0,03	198 000	USD Tenet Healthcare Corp, 4.875%, 01/01/26	195 812	0,04
178 000	USD Sunoco LP / Sunoco Finance Corp, 4.500%, 30/04/30	164 812	0,03	379 000	USD Tenet Healthcare Corp, 6.250%, 01/02/27	380 854	0,07
68 000	USD Surgery Center Holdings Inc, 10.000%, 15/04/27	68 680	0,01	490 000	USD Tenet Healthcare Corp, 5.125%, 01/11/27	478 984	0,09
150 000	USD SWF Escrow Issuer Corp, 6.500%, 01/10/29	107 813	0,02	200 000	USD Tenet Healthcare Corp, 4.625%, 15/06/28	190 771	0,04
100 000	USD Synaptics Inc, 4.000%, 15/06/29	89 699	0,02	630 000	USD Tenet Healthcare Corp, 6.125%, 01/10/28	628 217	0,12
213 000	USD Synchrony Financial, 7.250%, 02/02/33	211 794	0,04	300 000	USD Tenet Healthcare Corp, 4.250%, 01/06/29	279 508	0,05
450 000	USD Talen Energy Supply LLC, 8.625%, 01/06/30	480 118	0,09	514 000	USD Tenet Healthcare Corp, 4.375%, 15/01/30	476 421	0,09
83 000	USD Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 7.500%, 01/10/25	83 415	0,02	613 000	USD Tenet Healthcare Corp, 6.125%, 15/06/30	619 665	0,12
275 000	USD Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 6.000%, 01/03/27	268 917	0,05	350 000	USD Tenet Healthcare Corp, 6.750%, 15/05/31	357 717	0,07
				50 000	USD Tenet Healthcare Corp, 6.875%, 15/11/31	51 343	0,01
				550 000	USD Tenneco Inc, 8.000%, 17/11/28	469 562	0,09
				149 000	USD Terex Corp, 5.000%, 15/05/29	140 432	0,03
				200 000	USD Terraform Global Operating LP, 6.125%, perpetual	196 750	0,04
				151 000	USD TerraForm Power Operating LLC, 5.000%, 31/01/28	146 505	0,03

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
351 000	USD TerraForm Power Operating LLC, 4.750%, 15/01/30	326 430	0,06	73 000	USD TriNet Group Inc, 3.500%, 01/03/29	65 565	0,01
50 000	USD Texas Capital Bancshares Inc, 4.000%, 06/05/31	43 389	0,01	100 000	USD TriNet Group Inc, 7.125%, 15/08/31	103 016	0,02
98 000	USD Thor Industries Inc, 4.000%, 15/10/29	87 410	0,02	50 000	USD Trinity Industries Inc, 4.550%, 01/10/24	49 250	0,01
170 000	USD Titan International Inc, 7.000%, 30/04/28	170 085	0,03	105 000	USD Trinity Industries Inc, 7.750%, 15/07/28	108 474	0,02
541 000	USD TK Elevator US Newco Inc, 5.250%, 15/07/27	531 629	0,10	99 000	USD TripAdvisor Inc, 7.000%, 15/07/25	99 236	0,02
70 000	USD TKC Holdings Inc, 6.875%, 15/05/28	64 750	0,01	220 000	USD Triton Water Holdings Inc, 6.250%, 01/04/29	191 675	0,04
226 000	USD TKC Holdings Inc, 10.500%, 15/05/29	204 530	0,04	70 000	USD Triumph Group Inc, 7.750%, 15/08/25	69 824	0,01
108 000	USD TMS International Corp, 6.250%, 15/04/29	89 100	0,02	236 000	USD Triumph Group Inc, 9.000%, 15/03/28	250 903	0,05
33 000	USD Toledo Hospital, 5.325%, 15/11/28	30 236	0,01	294 000	USD Tronox Inc, 4.625%, 15/03/29	260 312	0,05
100 000	USD Toledo Hospital, 4.982%, 15/11/45	67 000	0,01	167 000	USD TTM Technologies Inc, 4.000%, 01/03/29	151 708	0,03
200 000	USD Toledo Hospital, 6.015%, 15/11/48	156 044	0,03	108 000	USD Tutor Perini Corp, 6.875%, 01/05/25	105 381	0,02
182 049	USD Topaz Solar Farms LLC, 5.750%, 30/09/39	180 884	0,03	68 000	USD Twilio Inc, 3.625%, 15/03/29	62 032	0,01
55 000	USD TopBuild Corp, 3.625%, 15/03/29	49 836	0,01	93 000	USD Twilio Inc, 3.875%, 15/03/31	82 831	0,02
80 000	USD TopBuild Corp, 4.125%, 15/02/32	71 167	0,01	214 000	USD Uber Technologies Inc, 7.500%, 15/09/27	221 625	0,04
193 000	USD Townsquare Media Inc, 6.875%, 01/02/26	189 063	0,04	83 000	USD Uber Technologies Inc, 6.250%, 15/01/28	83 208	0,02
100 000	USD TPC Group Inc, 13.000%, 16/12/27	101 147	0,02	500 000	USD Uber Technologies Inc, 4.500%, 15/08/29	476 901	0,09
1 090 000	USD TransDigm Inc, 6.250%, 15/03/26	1 088 050	0,21	200 000	EUR UGI International LLC, 2.500%, 01/12/29	187 263	0,04
112 000	USD TransDigm Inc, 7.500%, 15/03/27	112 475	0,02	175 000	USD Under Armour Inc, 3.250%, 15/06/26	165 201	0,03
646 000	USD TransDigm Inc, 5.500%, 15/11/27	632 705	0,12	175 000	USD Unisys Corp, 6.875%, 01/11/27	157 540	0,03
513 000	USD TransDigm Inc, 6.750%, 15/08/28	524 806	0,10	65 000	USD United Airlines Holdings Inc, 4.875%, 15/01/25	64 194	0,01
294 000	USD TransDigm Inc, 4.625%, 15/01/29	276 029	0,05	516 000	USD United Airlines Inc, 4.375%, 15/04/26	503 067	0,10
380 000	USD TransDigm Inc, 4.875%, 01/05/29	355 267	0,07	603 000	USD United Airlines Inc, 4.625%, 15/04/29	563 982	0,11
264 000	USD TransDigm Inc, 6.875%, 15/12/30	271 920	0,05	114 000	USD United Natural Foods Inc, 6.750%, 15/10/28	92 288	0,02
90 000	USD TransDigm Inc, 7.125%, 01/12/31	94 275	0,02	190 000	USD United Rentals North America Inc, 3.875%, 15/11/27	181 289	0,03
135 000	USD TransMontaigne Partners LP / TLP Finance Corp, 6.125%, 15/02/26	121 837	0,02	531 000	USD United Rentals North America Inc, 4.875%, 15/01/28	517 865	0,10
120 000	USD Travel & Leisure Co, 6.600%, 01/10/25	120 109	0,02	107 000	USD United Rentals North America Inc, 5.250%, 15/01/30	105 551	0,02
126 000	USD Travel & Leisure Co, 6.625%, 31/07/26	127 260	0,02	216 000	USD United Rentals North America Inc, 4.000%, 15/07/30	198 988	0,04
153 000	USD Travel & Leisure Co, 6.000%, 01/04/27	152 511	0,03	267 000	USD United Rentals North America Inc, 3.875%, 15/02/31	242 596	0,05
200 000	USD Travel & Leisure Co, 4.500%, 01/12/29	179 117	0,03	160 000	USD United Rentals North America Inc, 3.750%, 15/01/32	142 087	0,03
50 000	USD Travel & Leisure Co, 4.625%, 01/03/30	44 715	0,01	100 000	USD United States Cellular Corp, 6.700%, 15/12/33	101 902	0,02
100 000	USD TreeHouse Foods Inc, 4.000%, 01/09/28	88 519	0,02	82 000	USD United States Steel Corp, 6.875%, 01/03/29	83 887	0,02
50 000	USD Tri Pointe Homes Inc, 5.250%, 01/06/27	49 125	0,01				
150 000	USD Tri Pointe Homes Inc, 5.700%, 15/06/28	147 937	0,03				
146 000	USD Trident TPI Holdings Inc, 12.750%, 31/12/28	156 220	0,03				
100 000	USD TriMas Corp, 4.125%, 15/04/29	89 847	0,02				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
60 000 USD	United States Steel Corp, 6.650%, 01/06/37	62 848	0,01	560 000 USD	Venture Global LNG Inc, 8.375%, 01/06/31	560 131	0,11
182 000 USD	United Wholesale Mortgage LLC, 5.500%, 15/11/25	180 952	0,03	538 000 USD	Venture Global LNG Inc, 9.875%, 01/02/32	560 466	0,11
245 000 USD	United Wholesale Mortgage LLC, 5.750%, 15/06/27	240 127	0,05	250 000 USD	Verde Purchaser LLC, 10.500%, 30/11/30	251 912	0,05
147 000 USD	United Wholesale Mortgage LLC, 5.500%, 15/04/29	139 166	0,03	280 000 USD	Vericast Corp, 11.000%, 15/09/26	296 800	0,06
200 000 USD	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC, 6.000%, 15/01/30	139 782	0,03	450 000 USD	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd, 7.500%, 01/09/25	371 507	0,07
694 000 USD	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC, 10.500%, 15/02/28	703 510	0,13	310 000 USD	Verscend Escrow Corp, 9.750%, 15/08/26	312 094	0,06
240 000 USD	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC, 6.500%, 15/02/29	173 102	0,03	226 000 USD	Vertiv Group Corp, 4.125%, 15/11/28	212 065	0,04
59 000 USD	Univision Communications Inc, 5.125%, 15/02/25	58 782	0,01	117 000 USD	Viasat Inc, 5.625%, 15/09/25	114 081	0,02
379 000 USD	Univision Communications Inc, 6.625%, 01/06/27	377 930	0,07	349 000 USD	Viasat Inc, 5.625%, 15/04/27	337 657	0,06
175 250 USD	Univision Communications Inc, 8.000%, 15/08/28	180 825	0,03	65 000 USD	Viasat Inc, 6.500%, 15/07/28	53 381	0,01
392 000 USD	Univision Communications Inc, 4.500%, 01/05/29	350 761	0,07	250 000 USD	Viasat Inc, 7.500%, 30/05/31	196 250	0,04
189 000 USD	Univision Communications Inc, 7.375%, 30/06/30	188 471	0,04	75 000 USD	Viavi Solutions Inc, 3.750%, 01/10/29	65 658	0,01
125 000 USD	Upbound Group Inc, 6.375%, 15/02/29	117 314	0,02	220 000 USD	Vibrantz Technologies Inc, 9.000%, 15/02/30	172 665	0,03
174 000 USD	Urban One Inc, 7.375%, 01/02/28	147 897	0,03	193 000 USD	Victoria's Secret & Co, 4.625%, 15/07/29	161 189	0,03
238 000 USD	US Acute Care Solutions LLC, 6.375%, 01/03/26	198 863	0,04	70 000 USD	Viper Energy Inc, 5.375%, 01/11/27	68 694	0,01
50 000 USD	US Foods Inc, 6.875%, 15/09/28	51 468	0,01	100 000 USD	Viper Energy Inc, 7.375%, 01/11/31	103 500	0,02
276 000 USD	US Foods Inc, 4.750%, 15/02/29	262 181	0,05	195 000 USD	Virtusa Corp, 7.125%, 15/12/28	166 969	0,03
100 000 USD	US Foods Inc, 4.625%, 01/06/30	93 232	0,02	125 000 USD	Vista Outdoor Inc, 4.500%, 15/03/29	122 031	0,02
200 000 USD	US Foods Inc, 7.250%, 15/01/32	208 542	0,04	228 000 USD	Vital Energy Inc, 10.125%, 15/01/28	234 285	0,04
151 000 USD	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp, 6.875%, 01/04/26	150 359	0,03	150 000 USD	Vital Energy Inc, 7.750%, 31/07/29	143 403	0,03
353 000 USD	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp, 6.875%, 01/09/27	348 878	0,07	135 000 USD	Vital Energy Inc, 9.750%, 15/10/30	140 096	0,03
98 000 USD	USI Inc, 7.500%, 15/01/32	100 083	0,02	50 000 USD	Vm Consolidated Inc, 5.500%, perpetual	47 307	0,01
87 000 USD	Vail Resorts Inc, 6.250%, 15/05/25	86 565	0,02	17 000 USD	Vornado Realty LP, 3.500%, 15/01/25	16 460	0,00
195 000 USD	Valvoline Inc, 3.625%, 15/06/31	166 415	0,03	100 000 USD	Vornado Realty LP, 2.150%, 01/06/26	90 164	0,02
275 000 USD	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3.875%, 15/08/29	249 701	0,05	60 000 USD	Vornado Realty LP, 3.400%, 01/06/31	46 479	0,01
349 000 USD	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 6.250%, 15/01/30	347 088	0,07	213 000 USD	VT Topco Inc, 8.500%, 15/08/30	221 599	0,04
247 000 USD	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4.125%, 15/08/31	217 584	0,04	100 000 USD	W&T Offshore Inc, 11.750%, 01/02/26	103 072	0,02
300 000 USD	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3.875%, 01/11/33	254 504	0,05	166 000 USD	Wabash National Corp, 4.500%, 15/10/28	149 785	0,03
634 000 USD	Venture Global LNG Inc, 8.125%, 01/06/28	640 247	0,12	100 000 GBP	Walgreens Boots Alliance Inc, 3.600%, 20/11/25	121 469	0,02
900 000 USD	Venture Global LNG Inc, 9.500%, 01/02/29	952 121	0,18	291 000 USD	Walgreens Boots Alliance Inc, 3.450%, 01/06/26	276 710	0,05
				100 000 EUR	Walgreens Boots Alliance Inc, 2.125%, 20/11/26	102 565	0,02
				99 000 USD	Walgreens Boots Alliance Inc, 3.200%, 15/04/30	87 342	0,02
				136 000 USD	Walgreens Boots Alliance Inc, 4.800%, 18/11/44	113 099	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
8 000 USD	Walgreens Boots Alliance Inc, 4.650%, 01/06/46	6 274	0,00	45 000 USD	World Acceptance Corp, 7.000%, 01/11/26	40 838	0,01
158 000 USD	Walgreens Boots Alliance Inc, 4.100%, 15/04/50	114 832	0,02	150 000 USD	WR Grace Holdings LLC, 4.875%, 15/06/27	144 326	0,03
26 000 USD	Warrior Met Coal Inc, 7.875%, 01/12/28	25 800	0,01	316 000 USD	WR Grace Holdings LLC, 5.625%, 15/08/29	279 186	0,05
236 000 USD	WASH Multifamily Acquisition Inc, 5.750%, 15/04/26	228 263	0,04	50 000 USD	WR Grace Holdings LLC, 7.375%, 01/03/31	50 015	0,01
175 000 USD	Waste Pro USA Inc, 5.500%, 15/02/26	168 437	0,03	163 000 USD	WW International Inc, 4.500%, 15/04/29	108 103	0,02
80 000 USD	Watco Cos LLC / Watco Finance Corp, 6.500%, 15/06/27	80 000	0,02	91 000 USD	Wyndham Hotels & Resorts Inc, 4.375%, 15/08/28	85 115	0,02
120 000 USD	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp, 4.875%, 15/09/28	111 618	0,02	233 000 USD	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 5.500%, 01/03/25	231 786	0,04
205 000 USD	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc, 8.750%, 15/07/25	180 400	0,03	312 000 USD	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 5.250%, 15/05/27	303 546	0,06
100 000 USD	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc, 11.500%, 15/06/28	103 873	0,02	205 000 USD	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 5.125%, 01/10/29	193 505	0,04
235 000 USD	WESCO Distribution Inc, 7.125%, 15/06/25	236 746	0,05	125 000 USD	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 7.125%, 15/02/31	130 067	0,02
216 000 USD	WESCO Distribution Inc, 7.250%, 15/06/28	221 963	0,04	50 000 USD	Xerox Corp, 4.800%, 01/03/35	38 573	0,01
100 000 USD	West Technology Group LLC, 8.500%, 10/04/27	86 000	0,02	95 000 USD	Xerox Corp, 6.750%, 15/12/39	82 831	0,02
300 000 USD	Western Alliance Bancorp, 3.000%, 15/06/31	261 000	0,05	232 000 USD	Xerox Holdings Corp, 5.000%, 15/08/25	227 239	0,04
570 000 USD	Western Digital Corp, 4.750%, 15/02/26	559 408	0,11	161 000 USD	Xerox Holdings Corp, 5.500%, 15/08/28	145 330	0,03
104 000 USD	White Cap Buyer LLC, 6.875%, 15/10/28	100 673	0,02	100 000 USD	Xhr Lp, 4.875%, 01/06/29	92 049	0,02
125 000 USD	White Cap Parent LLC, 8.250%, 15/03/26	124 419	0,02	86 000 USD	XHR LP, 6.375%, 15/08/25	85 782	0,02
93 000 USD	William Carter Co, 5.625%, 15/03/27	91 836	0,02	70 000 USD	XPO CNW Inc, 6.700%, 01/05/34	71 588	0,01
82 000 USD	Williams Scotsman Inc, 6.125%, 15/06/25	82 162	0,02	125 000 USD	XPO Inc, 7.125%, 01/06/31	129 620	0,02
79 000 USD	Williams Scotsman Inc, 4.625%, 15/08/28	74 526	0,01	109 000 USD	XPO Inc, 7.125%, 01/02/32	112 450	0,02
150 000 USD	Williams Scotsman Inc, 7.375%, 01/10/31	157 375	0,03	332 000 USD	Yum! Brands Inc, 4.750%, 15/01/30	321 814	0,06
233 000 USD	Windsor Holdings III LLC, 8.500%, 15/06/30	243 492	0,05	186 000 USD	Yum! Brands Inc, 3.625%, 15/03/31	167 743	0,03
396 000 USD	Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp, 7.750%, 15/08/28	346 890	0,07	232 000 USD	Yum! Brands Inc, 4.625%, 31/01/32	217 020	0,04
150 000 USD	Winnebago Industries Inc, 6.250%, 15/07/28	147 375	0,03	230 000 USD	Yum! Brands Inc, 5.375%, 01/04/32	226 031	0,04
80 000 USD	WMG Acquisition Corp, 3.750%, 01/12/29	72 798	0,01	50 000 USD	Yum! Brands Inc, 6.875%, 15/11/37	54 863	0,01
100 000 USD	WMG Acquisition Corp, 3.875%, 15/07/30	90 462	0,02	80 000 USD	Yum! Brands Inc, 5.350%, 01/11/43	77 800	0,01
144 000 USD	WMG Acquisition Corp, 3.000%, 15/02/31	123 683	0,02	412 000 USD	Zayo Group Holdings Inc, 4.000%, 01/03/27	330 361	0,06
125 000 EUR	WMG Acquisition Corp, 2.250%, 15/08/31	120 821	0,02	244 000 USD	Zayo Group Holdings Inc, 6.125%, 01/03/28	179 208	0,03
143 000 USD	Wolverine World Wide Inc, 4.000%, 15/08/29	112 255	0,02	410 000 USD	ZF North America Capital Inc, 4.750%, 29/04/25	405 329	0,08
				150 000 USD	ZF North America Capital Inc, 6.875%, 14/04/28	155 754	0,03
				150 000 USD	ZF North America Capital Inc, 7.125%, 14/04/30	159 902	0,03

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 96,48 % (suite)				Obligations d'État – 0,10 % (suite)			
États-Unis (suite)				Ouzbékistan			
142 000	USD Ziff Davis Inc, 4.625%, 15/10/30	130 272	0,02	200 000	USD Uzbekneftegaz Jsc, 4.750%, perpetual	166 101	0,03
200 000	USD ZIPRECRUITER INC, 5.000%, perpetual	174 982	0,03	Ouzbékistan – Total			
96 000	USD ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp, 3.875%, 01/02/29	87 105	0,02	166 101 0,03			
États-Unis – Total				Total des obligations d'État			
264 408 450 50,48				531 198 0,10			
Ouzbékistan				Actions ordinaires et préférentielles – 0,00 %			
150 000	USD UzAuto Motors AJ, 4.850%, perpetual	132 646	0,03	Luxembourg			
Ouzbékistan – Total				100 EUR Ideal Standard International SA*			
132 646 0,03				0 0,00			
Total des obligations d'entreprise				Luxembourg – Total			
505 333 671 96,48				0 0,00			
Obligations d'État – 0,10 %				Royaume-Uni			
Pakistan				148 555 USD Venator Materials PLC			
200 000	USD Pakistan Water & Power Development Authority, 7.500%, 04/06/31	103 787	0,02	1 550 0,00			
Pakistan – Total				Royaume-Uni – Total			
103 787 0,02				1 550 0,00			
Turquie				Total des actions ordinaires et préférentielles			
250 000	USD Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS, 9.375%, 31/01/26	261 310	0,05	1 550 0,00			
Turquie – Total				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
261 310 0,05				505 866 419 96,58			
				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
				505 866 419 96,58			

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – 1,09 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CAD / Sold EUR, due 03/01/24	Bank of Montreal	717 000	490 615	1 809	0,00
Bought CAD / Sold GBP, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	100 000	58 500	1 263	0,00
Bought CAD / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	1 280 000	760 908	736	0,00
Bought CAD / Sold NOK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	421 000	3 237 685	478	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	7 000	5 170	139	0,00
Bought CAD / Sold USD, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	62 000	46 990	31	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 03/01/24	UBS AG	529 809	823 000	5 331	0,00
Bought CHF / Sold CAD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	470 326	730 000	6 635	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	14 217 318	14 804 000	538 957	0,10
Bought CHF / Sold EUR, due 03/01/24	Merrill Lynch International	339 567	360 000	5 780	0,00
Bought CHF / Sold EUR, due 02/02/24	BNP Paribas SA	14 282 042	15 164 000	249 724	0,05
Bought CHF / Sold GBP, due 03/01/24	Citibank NA	58 262	53 000	1 659	0,00
Bought CHF / Sold GBP, due 03/01/24	UBS AG	1 714 117	1 546 000	65 774	0,01
Bought CHF / Sold GBP, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	1 732 917	1 599 000	26 420	0,01
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	17 111 322	19 570 334	760 352	0,15
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	966 196	1 115 000	32 979	0,01
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	2 159 361	2 480 000	85 628	0,02
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	17 102 005	19 570 333	749 283	0,14
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Merrill Lynch International	17 104 471	19 570 333	752 213	0,14
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	17 477 525	20 573 000	255 391	0,05

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 1,09 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	Goldman Sachs International	17 475 679	20 573 000	253 192	0,05
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	Royal Bank of Canada	17 486 392	20 573 000	265 958	0,05
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	112 007	97 000	74	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	33 798	29 000	365	0,00
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	1 246 532	1 080 000	198	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Bank of Montreal	1 749 143	1 895 000	37 190	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	3 862 673	4 209 172	57 730	0,01
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	5 017 597	5 472 167	70 523	0,01
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	2 003 780	2 165 000	48 476	0,01
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	9 739 596	10 706 263	52 584	0,02
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	538 492	592 000	2 845	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Merrill Lynch International	9 423 919	10 357 999	52 134	0,02
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	13 678	15 000	109	0,00
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	UBS AG	9 424 540	10 358 003	52 817	0,02
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	11 509 565	12 612 572	101 471	0,02
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Goldman Sachs International	1 459 000	1 678 477	5 802	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 02/02/24	BNP Paribas SA	23 117 276	26 593 000	64 362	0,01
Bought GBP / Sold NOK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	850 000	10 999 770	467	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	26 324 383	33 414 877	143 438	0,03
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	3 340 288	4 230 000	28 198	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Goldman Sachs International	66 000	83 970	166	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	3 921 296	4 950 000	48 867	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Morgan Stanley And Co International	26 195 186	33 249 000	144 614	0,03
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	26 195 886	33 249 000	145 506	0,03
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	28 587 250	36 336 333	112 658	0,02
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Goldman Sachs International	28 555 255	36 336 333	71 863	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Royal Bank of Canada	28 577 309	36 336 334	99 981	0,02
Bought NOK / Sold CAD, due 03/01/24	UBS AG	4 085 677	521 000	7 182	0,00
Bought NOK / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	4 200 397	357 000	19 240	0,00
Bought NOK / Sold EUR, due 03/01/24	Goldman Sachs International	4 308 824	367 000	18 870	0,00
Bought NOK / Sold EUR, due 03/01/24	UBS AG	110 191 249	9 415 000	449 906	0,09
Bought NOK / Sold EUR, due 02/02/24	BNP Paribas SA	90 515 321	8 055 000	11 050	0,00
Bought NOK / Sold GBP, due 03/01/24	BNP Paribas SA	504 551	37 000	2 514	0,00
Bought NOK / Sold GBP, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	314 710	23 000	1 668	0,00
Bought NOK / Sold GBP, due 03/01/24	UBS AG	13 631 104	1 009 000	55 939	0,01
Bought NOK / Sold USD, due 03/01/24	Bank of Montreal	18 485 842	1 706 000	114 243	0,02
Bought NOK / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	15 625 105	1 451 000	87 555	0,02
Bought NOK / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	135 876 756	12 791 668	587 691	0,11
Bought NOK / Sold USD, due 03/01/24	Morgan Stanley And Co International	135 843 041	12 791 666	584 373	0,11
Bought NOK / Sold USD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	135 940 348	12 791 666	593 955	0,11

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 1,09 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought NOK / Sold USD, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	713 350	65 000	5 241	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	14 398 490	13 029 748	5 179	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	14 381 253	13 010 424	9 287	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Goldman Sachs International	14 547 325	13 159 702	10 459	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	14 205 249	12 849 615	10 920	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	351 931	318 000	242	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 02/02/24	BNP Paribas SA	348 661	315 000	289	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 02/02/24	Goldman Sachs International	348 685	315 000	312	0,00
Bought USD / Sold EUR, due 02/02/24	Royal Bank of Canada	348 653	315 000	281	0,00
Bought USD / Sold NOK, due 03/01/24	Citibank NA	11 019 666	111 826 039	8 506	0,00
Bought USD / Sold NOK, due 03/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	11 019 666	111 827 012	8 410	0,00
Bought USD / Sold NOK, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	11 019 668	111 844 583	6 682	0,00
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				8 002 164	1,53

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought CAD / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	730 000	471 597	(6 698)	(0,00)
Bought CAD / Sold CHF, due 03/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	93 000	59 807	(528)	(0,00)
Bought CAD / Sold NOK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	100 000	799 550	(2 890)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	30 046	44 000	(179)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	68 888	101 000	(500)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 03/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	165 483	247 000	(4 522)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 03/01/24	Morgan Stanley And Co International	217 868	325 000	(5 809)	(0,00)
Bought EUR / Sold CAD, due 02/02/24	Bank of Montreal	455 462	666 000	(1 591)	(0,00)
Bought EUR / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	15 164 000	14 309 412	(250 703)	(0,05)
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	BNP Paribas SA	26 886 358	23 346 316	(61 856)	(0,01)
Bought EUR / Sold GBP, due 02/02/24	Goldman Sachs International	1 676 761	1 459 000	(5 834)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	8 055 000	90 477 675	(11 097)	(0,00)
Bought EUR / Sold NOK, due 03/01/24	UBS AG	2 084 000	24 460 039	(106 413)	(0,02)
Bought EUR / Sold USD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	315 000	348 232	(268)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	12 893 786	14 269 249	(9 445)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	12 833 818	14 205 253	(11 770)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Goldman Sachs International	12 832 956	14 205 249	(12 719)	(0,00)
Bought EUR / Sold USD, due 02/02/24	Royal Bank of Canada	12 834 116	14 205 249	(11 437)	(0,00)
Bought GBP / Sold CAD, due 03/01/24	UBS AG	801 929	1 380 000	(24 282)	(0,01)
Bought GBP / Sold CAD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	761 094	1 280 000	(758)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	1 599 000	1 738 098	(26 704)	(0,01)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	883 502	1 024 000	(4 874)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Merrill Lynch International	814 603	949 000	(9 858)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	UBS AG	21 324 810	24 620 000	(11 626)	(0,00)
Bought GBP / Sold NOK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	219 000	2 994 556	(15 683)	(0,01)

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 1,09 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought NOK / Sold CAD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	3 236 547	421 000	(489)	(0,00)
Bought NOK / Sold GBP, due 02/02/24	BNP Paribas SA	10 992 955	850 000	(506)	(0,00)
Bought NOK / Sold USD, due 02/02/24	Citibank NA	111 738 113	11 019 666	(8 933)	(0,00)
	JPMorgan Chase Bank NA				
Bought NOK / Sold USD, due 02/02/24	London	111 737 840	11 019 666	(8 960)	(0,00)
Bought NOK / Sold USD, due 02/02/24	Royal Bank of Canada	111 756 547	11 019 668	(7 118)	(0,00)
Bought USD / Sold CAD, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	50 878	69 000	(1 451)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought USD / Sold CAD, due 02/02/24	Corporation	47 008	62 000	(32)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	20 851 000	17 773 772	(266 771)	(0,05)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	64 000	55 042	(1 397)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	International	20 573 000	17 530 253	(255 436)	(0,05)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	20 573 000	17 541 033	(268 245)	(0,05)
	Westpac Banking				
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	Corporation	245 000	212 964	(8 031)	(0,00)
Bought USD / Sold CHF, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	57 000	48 032	(241)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Merrill Lynch International	385 434	351 250	(2 575)	(0,00)
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	UBS AG	342 078	311 250	(1 744)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought USD / Sold EUR, due 03/01/24	Corporation	463 137	422 334	(3 396)	(0,00)
	Westpac Banking				
Bought USD / Sold EUR, due 02/02/24	Corporation	27 000	24 478	(71)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	36 336 333	28 591 902	(112 613)	(0,02)
	Goldman Sachs				
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	International	36 336 333	28 560 013	(71 961)	(0,02)
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	Merrill Lynch International	83 790	66 000	(347)	(0,00)
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	36 420 136	28 648 029	(100 361)	(0,02)
Bought USD / Sold GBP, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	83 891	66 000	(260)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought USD / Sold GBP, due 02/02/24	International	83 985	66 000	(166)	(0,00)
Bought USD / Sold NOK, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	2 846 000	30 939 273	(200 493)	(0,04)
Bought USD / Sold NOK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	2 846 000	30 939 310	(200 497)	(0,04)
Bought USD / Sold NOK, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	2 846 000	30 938 910	(200 458)	(0,04)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(2 320 596)	(0,44)
Total des contrats de change à terme – couverture				5 681 568	1,09
Autres actifs/(passifs) nets				12 223 645	2,33
TOTAL DES ACTIFS NETS				523 771 632	100,00

* Le Conseil d'administration a décidé de fixer le prix du titre à 0,00 conformément aux procédures d'évaluation des investissements en vigueur.

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Obligations d'État – 97,64 %				Obligations d'État – 97,64 % (<i>suite</i>)			
Brésil				Chine			
19 000 000 BRL	Brazil Letras do Tesouro Nacional, zero coupon, 01/07/24	3 721 938	1,02	300 000 CNY	China Development Bank, 3.300%, 01/02/24	42 350	0,01
41 200 000 BRL	Brazil Letras do Tesouro Nacional, zero coupon, 01/07/25	7 173 539	1,96	1 100 000 CNY	China Development Bank, 3.340%, 14/07/25	157 519	0,04
29 500 000 BRL	Brazil Letras do Tesouro Nacional, zero coupon, 01/07/26	4 818 892	1,32	1 100 000 CNY	China Development Bank, 3.390%, 10/07/27	159 818	0,04
13 500 000 BRL	Brazil Letras do Tesouro Nacional, zero coupon, 01/07/27	1 999 251	0,55	1 700 000 CNY	China Development Bank, 3.450%, 20/09/29	250 511	0,07
17 500 000 BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10.000%, 01/01/25	3 605 529	0,99	1 700 000 CNY	China Development Bank, 3.700%, 20/10/30	254 935	0,07
16 350 000 BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10.000%, 01/01/27	3 382 479	0,92	3 500 000 CNY	China Government Bond, 2.940%, 17/10/24	496 852	0,14
27 500 000 BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10.000%, 01/01/29	5 647 433	1,54	6 000 000 CNY	China Government Bond, 2.260%, 24/02/25	846 901	0,23
18 650 000 BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10.000%, 01/01/31	3 787 581	1,03	3 400 000 CNY	China Government Bond, 1.990%, 09/04/25	478 154	0,13
400 000 BRL	Brazilian Government International Bond, 8.500%, 05/01/24	82 337	0,02	900 000 CNY	China Government Bond, 2.240%, 25/05/25	127 007	0,03
Brésil – Total		34 218 979	9,35	2 000 000 CNY	China Government Bond, 2.180%, 25/08/25	281 911	0,08
Chili				5 000 000 CNY	China Government Bond, 3.020%, 22/10/25	715 678	0,20
1 825 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 2.500%, 01/03/25	2 004 310	0,55	2 000 000 CNY	China Government Bond, 2.280%, 25/11/25	282 356	0,08
765 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.500%, 01/03/26	860 326	0,23	2 100 000 CNY	China Government Bond, 3.220%, 06/12/25	302 154	0,08
275 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 2.300%, 01/10/28	275 285	0,08	4 000 000 CNY	China Government Bond, 2.460%, 15/02/26	566 526	0,16
320 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.000%, 01/10/28	361 313	0,10	1 700 000 CNY	China Government Bond, 3.030%, 11/03/26	244 042	0,07
1 445 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4.700%, 01/09/30	1 594 701	0,44	3 000 000 CNY	China Government Bond, 2.300%, 15/05/26	423 365	0,12
400 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 6.000%, 01/04/33	479 388	0,13	4 900 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 06/06/26	708 191	0,19
655 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 7.000%, 01/05/34	845 045	0,23	6 800 000 CNY	China Government Bond, 2.690%, 12/08/26	968 581	0,26
1 435 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.000%, 01/03/35	1 614 928	0,44	800 000 CNY	China Government Bond, 3.120%, 05/12/26	115 617	0,03
600 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 6.000%, 01/01/43	747 306	0,20	800 000 CNY	China Government Bond, 2.370%, 20/01/27	112 926	0,03
120 000 000 CLP	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 5.100%, 15/07/50	134 182	0,04	500 000 CNY	China Government Bond, 2.480%, 15/04/27	70 744	0,02
Chili – Total		8 916 784	2,44	6 000 000 CNY	China Government Bond, 2.850%, 04/06/27	859 681	0,24
				900 000 CNY	China Government Bond, 2.710%, 19/06/27	128 385	0,04
				500 000 CNY	China Government Bond, 2.440%, 15/10/27	70 736	0,02
				3 400 000 CNY	China Government Bond, 3.280%, 03/12/27	497 598	0,14
				1 000 000 CNY	China Government Bond, 2.640%, 15/01/28	142 381	0,04
				3 200 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 15/04/28	455 719	0,12
				2 800 000 CNY	China Government Bond, 3.010%, 13/05/28	405 079	0,11
				7 000 000 CNY	China Government Bond, 2.400%, 15/07/28	987 927	0,27

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 97,64 % (suite)				Obligations d'État – 97,64 % (suite)			
Chine (suite)				Colombie			
1 100 000 CNY	China Government Bond, 2.910%, 14/10/28	158 671	0,04	159 000 000 COP	Colombia Government International Bond, 9.850%, 28/06/27	39 555	0,01
2 300 000 CNY	China Government Bond, 3.250%, 22/11/28	337 459	0,09	3 313 600 000 COP	Colombian TES, 6.250%, 26/11/25	811 576	0,22
4 600 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 24/03/29	659 619	0,18	9 008 500 000 COP	Colombian TES, 7.500%, 26/08/26	2 226 546	0,61
2 500 000 CNY	China Government Bond, 3.290%, 23/05/29	368 314	0,10	2 900 000 000 COP	Colombian TES, 5.750%, 03/11/27	663 369	0,18
1 100 000 CNY	China Government Bond, 2.750%, 15/06/29	157 295	0,04	6 402 000 000 COP	Colombian TES, 6.000%, 28/04/28	1 459 930	0,40
3 600 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 25/09/29	511 287	0,14	1 807 100 000 COP	Colombian TES, 7.750%, 18/09/30	425 410	0,12
1 900 000 CNY	China Government Bond, 3.130%, 21/11/29	277 655	0,08	9 219 000 000 COP	Colombian TES, 7.000%, 26/03/31	2 056 879	0,56
2 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 25/03/30	286 013	0,08	6 837 500 000 COP	Colombian TES, 7.000%, 30/06/32	1 479 893	0,41
8 100 000 CNY	China Government Bond, 2.680%, 21/05/30	1 151 664	0,31	6 205 000 000 COP	Colombian TES, 13.250%, 09/02/33	1 907 925	0,52
6 500 000 CNY	China Government Bond, 2.620%, 25/06/30	921 352	0,25	4 397 200 000 COP	Colombian TES, 7.250%, 18/10/34	935 024	0,26
5 000 000 CNY	China Government Bond, 2.600%, 15/09/30	708 026	0,19	2 553 800 000 COP	Colombian TES, 6.250%, 09/07/36	482 295	0,13
2 500 000 CNY	China Government Bond, 3.270%, 19/11/30	370 149	0,10	8 297 000 000 COP	Colombian TES, 9.250%, 28/05/42	1 952 044	0,53
6 600 000 CNY	China Government Bond, 3.020%, 27/05/31	960 078	0,26	4 163 700 000 COP	Colombian TES, 7.250%, 26/10/50	783 375	0,21
				Colombie – Total		15 223 821	4,16
2 700 000 CNY	China Government Bond, 2.890%, 18/11/31	389 553	0,11	République tchèque			
900 000 CNY	China Government Bond, 2.750%, 17/02/32	128 435	0,04	1 700 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.700%, 25/05/24	76 428	0,02
3 600 000 CNY	China Government Bond, 2.690%, 15/08/32	511 393	0,14	21 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.010%, 12/12/24	897 801	0,24
800 000 CNY	China Government Bond, 2.600%, 01/09/32	112 842	0,03	45 650 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.250%, 14/02/25	1 967 111	0,54
3 000 000 CNY	China Government Bond, 2.800%, 15/11/32	430 159	0,12	33 700 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.400%, 17/09/25	1 458 098	0,40
2 200 000 CNY	China Government Bond, 2.880%, 25/02/33	317 990	0,09	12 300 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 6.000%, 26/02/26	573 625	0,16
5 000 000 CNY	China Government Bond, 2.670%, 25/05/33	708 523	0,19	29 800 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.000%, 26/06/26	1 238 049	0,34
2 000 000 CNY	China Government Bond, 2.520%, 25/08/33	280 697	0,08	59 200 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.250%, 10/02/27	2 366 903	0,65
3 600 000 CNY	China Government Bond, 3.810%, 14/09/50	593 577	0,16	43 900 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.500%, 25/08/28	1 864 458	0,51
3 250 000 CNY	China Government Bond, 3.720%, 12/04/51	528 111	0,14	36 600 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.500%, 12/12/28	1 776 810	0,48
1 000 000 CNY	China Government Bond, 3.530%, 18/10/51	157 507	0,04	9 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.750%, 29/03/29	441 243	0,12
1 100 000 CNY	China Government Bond, 3.320%, 15/04/52	167 924	0,05	47 900 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.750%, 23/07/29	2 038 294	0,56
2 000 000 CNY	China Government Bond, 3.120%, 25/10/52	294 478	0,08	34 900 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.050%, 29/11/29	1 263 293	0,34
1 000 000 CNY	China Government Bond, 3.190%, 15/04/53	150 118	0,04	42 400 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 0.950%, 15/05/30	1 605 604	0,44
Chine – Total		22 792 533	6,23	19 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 5.000%, 30/09/30	915 204	0,25
				69 300 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.200%, 13/03/31	2 613 975	0,71

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 97,64 % (suite)				Obligations d'État – 97,64 % (suite)			
République tchèque (suite)				Hongrie (suite)			
2 500 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 6.200%, 16/06/31	129 977	0,04	518 700 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.750%, 22/12/26	1 365 642	0,37
44 700 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.750%, 23/06/32	1 724 261	0,47	316 600 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 27/10/27	833 459	0,23
7 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.500%, 11/11/32	331 374	0,09	240 600 000 HUF	Hungary Government Bond, 4.500%, 23/03/28	663 218	0,18
38 400 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 2.000%, 13/10/33	1 478 452	0,40	505 400 000 HUF	Hungary Government Bond, 6.750%, 22/10/28	1 517 286	0,42
13 500 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.900%, 14/04/34	663 484	0,18	20 900 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.000%, 23/05/29	50 436	0,01
18 700 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 3.500%, 30/05/35	817 924	0,22	194 700 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 21/08/30	482 421	0,13
35 000 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 4.200%, 04/12/36	1 632 564	0,45	283 600 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.250%, 22/10/31	697 464	0,19
28 500 000 CZK	Czech Republic Government Bond, 1.500%, 24/04/40	918 768	0,25	350 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 4.500%, 27/05/32	920 951	0,25
République tchèque – Total		28 793 700	7,86	558 400 000 HUF	Hungary Government Bond, 4.750%, 24/11/32	1 490 597	0,41
République dominicaine				13 000 000 HUF Hungary Government Bond, 2.250%, 20/04/33			
8 200 000 DOP	Dominican Republic International Bond, 9.750%, 05/06/26	141 396	0,04	296 400 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.250%, 22/06/34	624 978	0,17
15 000 000 DOP	Dominican Republic International Bond, 13.625%, 03/02/33	314 258	0,08	365 200 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 27/10/38	740 077	0,20
République dominicaine – Total		455 654	0,12	144 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 25/04/41	281 530	0,08
Égypte				Hongrie – Total			
8 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.522%, 04/01/25	141 348	0,04			14 536 353	3,97
15 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.369%, 20/10/25	258 771	0,07	Indonésie			
6 250 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.483%, 06/04/26	105 234	0,03	22 357 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.500%, 15/06/25	1 455 318	0,40
7 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.563%, 06/07/26	116 640	0,03	5 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 11.000%, 15/09/25	348 445	0,10
3 500 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.285%, 11/01/27	51 247	0,02	17 550 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 5.500%, 15/04/26	1 119 885	0,31
3 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.556%, 13/10/27	47 088	0,01	18 219 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 15/09/26	1 243 038	0,34
2 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.292%, 05/01/28	30 875	0,01	31 627 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 5.125%, 15/04/27	1 986 316	0,54
5 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 16.100%, 07/05/29	78 820	0,02	19 985 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/05/27	1 323 940	0,36
6 000 000 EGP	Egypt Government Bond, 14.664%, 06/10/30	86 183	0,02	20 149 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.125%, 15/05/28	1 297 508	0,35
Égypte – Total		916 206	0,25	20 054 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.375%, 15/08/28	1 303 113	0,36
Hongrie				14 448 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 9.000%, 15/03/29	1 038 770	0,28
78 700 000 HUF	Hungary Government Bond, 3.000%, 26/06/24	223 292	0,06	5 700 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.875%, 15/04/29	376 617	0,10
376 400 000 HUF	Hungary Government Bond, 2.500%, 24/10/24	1 048 524	0,29	13 827 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.250%, 15/05/29	971 222	0,27
464 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 5.500%, 24/06/25	1 326 777	0,36	21 916 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/09/30	1 461 826	0,40
407 500 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.500%, 22/04/26	1 061 774	0,29	27 565 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.500%, 15/02/31	1 789 210	0,49
68 900 000 HUF	Hungary Government Bond, 1.500%, 26/08/26	177 299	0,05	14 020 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.750%, 15/05/31	1 025 298	0,28
320 000 000 HUF	Hungary Government Bond, 9.500%, 21/10/26	1 002 139	0,27				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 97,64 % (suite)				Obligations d'État – 97,64 % (suite)			
Indonésie (suite)				Malaisie (suite)			
27 080 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.375%, 15/04/32	1 742 955	0,48	3 700 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.519%, 20/04/28	803 693	0,22
11 774 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/08/32	810 958	0,22	5 930 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.733%, 15/06/28	1 296 889	0,35
36 659 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.000%, 15/02/33	2 472 584	0,68	1 800 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.504%, 30/04/29	407 744	0,11
12 261 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.625%, 15/05/33	801 898	0,22	2 900 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.885%, 15/08/29	638 041	0,17
22 565 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 15/03/34	1 658 997	0,45	3 600 000 MYR	Malaysia Government Bond, 2.632%, 15/04/31	727 580	0,20
13 785 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/06/35	962 900	0,26	9 000 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.582%, 15/07/32	1 927 841	0,53
13 984 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.250%, 15/05/36	1 030 840	0,28	600 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.642%, 07/11/33	140 298	0,04
4 886 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.250%, 15/06/36	310 036	0,08	5 090 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.828%, 05/07/34	1 103 494	0,30
791 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 6.375%, 15/07/37	50 603	0,01	4 900 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.254%, 31/05/35	1 097 259	0,30
10 695 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/05/38	744 975	0,20	2 900 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.762%, 07/04/37	680 452	0,19
16 000 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.125%, 15/06/38	1 089 563	0,30	3 800 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.893%, 08/06/38	908 767	0,25
12 071 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 8.375%, 15/04/39	905 501	0,25	5 250 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.757%, 22/05/40	1 095 045	0,30
17 396 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.500%, 15/04/40	1 210 665	0,33	5 700 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.696%, 15/10/42	1 337 329	0,36
18 742 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.125%, 15/06/42	1 269 255	0,35	2 800 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.921%, 06/07/48	670 824	0,18
6 800 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.125%, 15/06/43	459 752	0,13	5 310 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.065%, 15/06/50	1 120 936	0,31
609 000 000 IDR	Indonesia Treasury Bond, 7.375%, 15/05/48	41 773	0,01	2 500 000 MYR	Malaysia Government Bond, 4.457%, 31/03/53	563 953	0,15
1 279 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.625%, 15/10/24	83 212	0,02	5 200 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.655%, 15/10/24	1 133 985	0,31
5 000 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 4.875%, 15/07/26	311 608	0,08	1 300 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.128%, 15/08/25	286 458	0,08
10 000 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 8.875%, 15/11/31	734 851	0,20	2 800 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.990%, 15/10/25	616 122	0,17
13 937 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.375%, 15/03/34	883 158	0,24	7 900 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.726%, 31/03/26	1 730 409	0,47
9 000 000 000 IDR	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia, 6.875%, 15/03/36	593 420	0,16	3 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.070%, 30/09/26	662 432	0,18
Indonésie – Total		34 910 010	9,53	1 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.258%, 26/07/27	334 076	0,09
Malaisie				5 680 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.422%, 30/09/27	1 232 375	0,34
6 400 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.882%, 14/03/25	1 400 952	0,38	6 500 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.599%, 31/07/28	1 414 291	0,39
6 200 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.955%, 15/09/25	1 363 271	0,37	4 400 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.369%, 31/10/28	988 530	0,27
2 500 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.906%, 15/07/26	550 185	0,15	4 250 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.130%, 09/07/29	943 542	0,26
2 250 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.900%, 30/11/26	495 859	0,14	1 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.245%, 30/09/30	224 101	0,06
3 700 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.502%, 31/05/27	803 898	0,22	5 400 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.465%, 15/10/30	1 150 788	0,31
4 580 000 MYR	Malaysia Government Bond, 3.899%, 16/11/27	1 009 833	0,28	4 700 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.193%, 07/10/32	1 051 578	0,29

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 97,64 % (suite)				Obligations d'État – 97,64 % (suite)			
Malaisie (suite)				Pologne			
4 650 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 3.447%, 15/07/36	960 840	0,26	1 350 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/04/24	340 630	0,09
1 800 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.662%, 31/03/38	421 500	0,11	1 050 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, zero coupon, 25/07/24	259 639	0,07
300 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.467%, 15/09/39	68 252	0,02	9 400 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.250%, 25/10/24	2 337 540	0,64
4 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.417%, 30/09/41	902 111	0,25	17 100 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 0.750%, 25/04/25	4 118 829	1,12
3 000 000 MYR	Malaysia Government Investment Issue, 4.291%, 14/08/43	670 051	0,18	7 100 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.250%, 25/07/25	1 758 474	0,48
Malaisie – Total		34 935 584	9,54	7 700 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/26	1 844 945	0,50
Mexique				Pologne			
53 400 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 05/09/24	3 096 471	0,85	15 800 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 0.250%, 25/10/26	3 531 791	0,96
17 400 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 05/12/24	1 022 030	0,28	8 500 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 3.750%, 25/05/27	2 083 189	0,57
14 800 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 05/12/24	869 313	0,24	6 800 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.500%, 25/07/27	1 597 501	0,44
18 300 000 MXN	Mexican Bonos, 5.000%, 06/03/25	1 022 550	0,28	16 900 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/04/28	3 941 722	1,08
74 800 000 MXN	Mexican Bonos, 5.750%, 05/03/26	4 076 080	1,11	14 200 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 7.500%, 25/07/28	3 973 508	1,09
12 200 000 MXN	Mexican Bonos, 7.000%, 03/09/26	677 648	0,19	13 900 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 2.750%, 25/10/29	3 159 044	0,86
45 900 000 MXN	Mexican Bonos, 5.500%, 04/03/27	2 425 508	0,66	4 700 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.250%, 25/10/30	946 873	0,26
45 300 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 03/06/27	2 539 349	0,69	12 950 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 1.750%, 25/04/32	2 563 753	0,70
31 300 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 01/03/29	1 805 528	0,49	9 450 000 PLN	Republic of Poland Government Bond, 6.000%, 25/10/33	2 548 358	0,70
34 600 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 31/05/29	2 003 774	0,55	Pologne – Total		35 005 796	9,56
64 500 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 29/05/31	3 561 183	0,97	Roumanie			
35 500 000 MXN	Mexican Bonos, 7.500%, 26/05/33	1 906 585	0,52	1 800 000 RON	Romania Government Bond, 3.700%, 25/11/24	391 859	0,11
20 000 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 23/11/34	1 082 701	0,30	5 100 000 RON	Romania Government Bond, 4.750%, 24/02/25	1 117 077	0,31
7 300 000 MXN	Mexican Bonos, 10.000%, 20/11/36	465 289	0,13	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 3.500%, 25/11/25	424 594	0,12
41 000 000 MXN	Mexican Bonos, 8.500%, 18/11/38	2 316 599	0,63	4 450 000 RON	Romania Government Bond, 4.850%, 22/04/26	962 857	0,26
50 700 000 MXN	Mexican Bonos, 7.750%, 13/11/42	2 645 909	0,72	5 100 000 RON	Romania Government Bond, 3.250%, 24/06/26	1 060 654	0,29
39 700 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 07/11/47	2 102 838	0,57	4 000 000 RON	Romania Government Bond, 7.200%, 28/10/26	910 125	0,25
25 200 000 MXN	Mexican Bonos, 8.000%, 31/07/53	1 327 172	0,36	2 000 000 RON	Romania Government Bond, 7.200%, 31/05/27	456 828	0,12
Mexique – Total		34 946 527	9,54	4 600 000 RON	Romania Government Bond, 5.800%, 26/07/27	1 010 165	0,28
Pérou				Roumanie			
800 000 PEN	Peru Government Bond, 5.700%, 12/08/24	216 212	0,06	1 830 000 RON	Romania Government Bond, 2.500%, 25/10/27	357 166	0,10
2 400 000 PEN	Peru Government Bond, 6.350%, 12/08/28	663 234	0,18	2 750 000 RON	Romania Government Bond, 4.150%, 26/01/28	568 255	0,16
5 950 000 PEN	Peru Government Bond, 5.940%, 12/02/29	1 606 594	0,44	6 300 000 RON	Romania Government Bond, 8.750%, 30/10/28	1 543 141	0,42
2 850 000 PEN	Peru Government Bond, 6.950%, 12/08/31	795 899	0,22	4 900 000 RON	Romania Government Bond, 5.000%, 12/02/29	1 031 714	0,28
3 950 000 PEN	Peru Government Bond, 6.150%, 12/08/32	1 042 295	0,29				
4 550 000 PEN	Peru Government Bond, 7.300%, 12/08/33	1 287 405	0,35				
3 500 000 PEN	Peru Government Bond, 5.400%, 12/08/34	854 430	0,23				
3 020 000 PEN	Peru Government Bond, 6.900%, 12/08/37	821 207	0,22				
2 700 000 PEN	Peru Government Bond, 5.350%, 12/08/40	624 778	0,17				
Pérou – Total		7 912 054	2,16				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 97,64 % (suite)				Obligations d'État – 97,64 % (suite)				
Roumanie (suite)				Afrique du Sud (suite)				
5 000 000 RON	Romania Government Bond, 4.850%, 25/07/29	1 040 667	0,28	68 300 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.750%, 28/02/48	2 752 334	0,75	
2 780 000 RON	Romania Government Bond, 4.150%, 24/10/30	549 080	0,15	3 000 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 11.625%, 31/03/53	157 100	0,04	
3 500 000 RON	Romania Government Bond, 7.350%, 28/04/31	823 921	0,22	Afrique du Sud – Total			28 860 004	7,88
2 100 000 RON	Romania Government Bond, 3.650%, 24/09/31	393 920	0,11	Thaïlande				
6 500 000 RON	Romania Government Bond, 6.700%, 25/02/32	1 480 671	0,40	50 200 000 THB	Thailand Government Bond, 0.750%, 17/09/24	1 453 987	0,40	
1 600 000 RON	Romania Government Bond, 8.250%, 29/09/32	402 728	0,11	50 000 000 THB	Thailand Government Bond, 1.450%, 17/12/24	1 453 563	0,40	
1 800 000 RON	Romania Government Bond, 7.200%, 30/10/33	428 387	0,12	56 700 000 THB	Thailand Government Bond, 0.950%, 17/06/25	1 627 285	0,44	
5 500 000 RON	Romania Government Bond, 4.750%, 11/10/34	1 079 123	0,29	45 300 000 THB	Thailand Government Bond, 3.850%, 12/12/25	1 365 616	0,37	
3 800 000 RON	Romania Government Bond, 4.250%, 28/04/36	700 886	0,19	62 900 000 THB	Thailand Government Bond, 2.350%, 17/06/26	1 841 492	0,50	
2 170 000 RON	Romania Government Bond, 7.900%, 24/02/38	555 907	0,15	38 500 000 THB	Thailand Government Bond, 2.125%, 17/12/26	1 120 174	0,31	
Roumanie – Total		17 289 725	4,72	33 145 000 THB	Thailand Government Bond, 2.250%, 17/03/27	966 136	0,26	
Serbie				51 800 000 THB	Thailand Government Bond, 1.000%, 17/06/27	1 446 318	0,40	
85 300 000 RSD	Serbia Treasury Bonds, 4.500%, 11/01/26	752 198	0,21	900 000 THB	Thailand Government Bond, 3.580%, 17/12/27	27 531	0,01	
14 800 000 RSD	Serbia Treasury Bonds, 5.875%, 08/02/28	143 596	0,04	45 500 000 THB	Thailand Government Bond, 2.650%, 17/06/28	1 344 831	0,37	
Serbie – Total		895 794	0,25	62 100 000 THB	Thailand Government Bond, 2.875%, 17/12/28	1 855 914	0,51	
Afrique du Sud				10 000 000 THB	Thailand Government Bond, 2.400%, 17/03/29	292 268	0,08	
71 500 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 10.500%, 21/12/26	4 093 378	1,12	71 100 000 THB	Thailand Government Bond, 4.875%, 22/06/29	2 336 171	0,64	
92 900 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.000%, 31/01/30	4 676 518	1,28	59 500 000 THB	Thailand Government Bond, 1.600%, 17/12/29	1 655 445	0,45	
36 500 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 7.000%, 28/02/31	1 672 695	0,46	25 200 000 THB	Thailand Government Bond, 3.650%, 20/06/31	789 467	0,22	
55 400 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.250%, 31/03/32	2 647 372	0,72	76 300 000 THB	Thailand Government Bond, 2.000%, 17/12/31	2 134 176	0,58	
68 400 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.875%, 28/02/35	3 158 587	0,86	43 700 000 THB	Thailand Government Bond, 3.775%, 25/06/32	1 391 448	0,38	
5 900 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 6.250%, 31/03/36	212 037	0,06	56 200 000 THB	Thailand Government Bond, 3.350%, 17/06/33	1 735 980	0,47	
64 300 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.500%, 31/01/37	2 744 044	0,75	10 400 000 THB	Thailand Government Bond, 1.600%, 17/06/35	271 482	0,07	
77 000 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 9.000%, 31/01/40	3 284 470	0,90	61 200 000 THB	Thailand Government Bond, 1.585%, 17/12/35	1 586 529	0,43	
8 000 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 6.500%, 28/02/41	264 977	0,07	30 600 000 THB	Thailand Government Bond, 3.400%, 17/06/36	945 442	0,26	
78 800 000 ZAR	Republic of South Africa Government Bond, 8.750%, 31/01/44	3 196 492	0,87	40 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.390%, 17/06/37	1 240 771	0,34	
				83 900 000 THB	Thailand Government Bond, 3.300%, 17/06/38	2 542 969	0,69	
				29 700 000 THB	Thailand Government Bond, 2.000%, 17/06/42	736 603	0,20	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 97,64 % (suite)				Obligations d'État – 97,64 % (suite)			
Thaïlande (suite)				Turquie (suite)			
40 000 000 THB	Thailand Government Bond, 3.450%, 17/06/43	1 226 643	0,34	3 700 000 TRY	Turkiye Government Bond, 12.400%, 08/03/28	83 937	0,02
25 100 000 THB	Thailand Government Bond, 2.875%, 17/06/46	674 705	0,18	15 500 000 TRY	Turkiye Government Bond, 17.300%, 19/07/28	423 266	0,12
2 600 000 THB	Thailand Government Bond, 1.875%, 17/06/49	55 503	0,02	2 000 000 TRY	Turkiye Government Bond, 17.800%, 13/07/33	52 888	0,02
Thaïlande – Total			9,32	9 500 000 TRY	Turkiye Government Bond, 26.200%, 05/10/33	332 921	0,09
Turquie				Turquie – Total			
400 000 TRY	Turkiye Government Bond, 10.400%, 20/03/24	12 821	0,00	1 978 258 0,54			
1 500 000 TRY	Turkiye Government Bond, 9.000%, 24/07/24	43 780	0,01	Uruguay			
900 000 TRY	Turkiye Government Bond, 8.000%, 12/03/25	22 642	0,01	13 000 000 UYU	Uruguay Government International Bond, 8.500%, 15/03/28	320 602	0,09
25 000 000 TRY	Turkiye Government Bond, 12.600%, 01/10/25	600 156	0,16	10 700 000 UYU	Uruguay Government International Bond, 8.250%, 21/05/31	255 595	0,07
2 100 000 TRY	Turkiye Government Bond, 10.600%, 11/02/26	48 955	0,01	9 000 000 UYU	Uruguay Government International Bond, 9.750%, 20/07/33	234 046	0,06
6 000 000 TRY	Turkiye Government Bond, 16.900%, 02/09/26	155 069	0,04	Uruguay – Total			
4 600 000 TRY	Turkiye Government Bond, 11.000%, 24/02/27	102 330	0,03	810 243 0,22			
4 350 000 TRY	Turkiye Government Bond, 10.500%, 11/08/27	99 493	0,03	Total des obligations d'État			
				357 516 474 97,64			
				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
				357 516 474 97,64			
				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
				357 516 474 97,64			

Produits dérivés

Contrats de change à terme – 0,01 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought EGP / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	10 600 000	333 701	7 071	0,00
Bought EGP / Sold USD, due 06/02/24	HSBC Bank PLC	10 600 000	267 002	18 474	0,01
Bought USD / Sold COP, due 06/02/24	BNP Paribas SA	739 703	2 850 000 000	9 078	0,00
Bought USD / Sold IDR, due 06/02/24	BNP Paribas SA	550 399	8 480 000 000	369	0,00
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme				34 992	0,01

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant Sold	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought COP / Sold USD, due 06/02/24	Merrill Lynch International	2 850 000 000	737 753	(7 128)	(0,00)
Bought USD / Sold EGP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	331 250	10 600 000	(9 521)	(0,00)
Bought USD / Sold MYR, due 06/02/24	Barclays Bank PLC	400 953	1 850 000	(3 296)	(0,00)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme				(19 945)	(0,00)
Total des contrats de change à terme				15 047	0,01
Autres actifs/(passifs) nets				8 621 092	2,35
TOTAL DES ACTIFS NETS				366 152 613	100,00

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Actions ordinaires et préférentielles – 96,62 %				Actions ordinaires et préférentielles – 96,62 % (<i>suite</i>)			
Pays-Bas				États-Unis (<i>suite</i>)			
289	USD ASML Holding NV	218 750	2,06	445	USD Visa Inc	115 856	1,09
Pays-Bas – Total				1 363 USD Waste Management Inc			
218 750 2,06				244 113 2,30			
Suisse				États-Unis – Total			
871	USD Chubb Ltd	196 846	1,85	9 596 623 90,42			
Suisse – Total				Total des actions ordinaires et préférentielles			
196 846 1,85				10 254 949 96,62			
Royaume-Uni				Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
591	USD Linde PLC	242 730	2,29	10 254 949 96,62			
Royaume-Uni – Total				TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
242 730 2,29				10 254 949 96,62			
États-Unis				Autres actifs/(passifs) nets			
1 335	USD Alphabet Inc	188 142	1,77	358 588 3,38			
3 226	USD Alphabet Inc	450 640	4,25	TOTAL DES ACTIFS NETS			
3 559	USD Amazon.com Inc	540 754	5,09	10 613 537 100,00			
1 057	USD American Tower Corp REIT	228 185	2,15				
2 035	USD Amphenol Corp	201 730	1,90				
2 471	USD Apple Inc	475 742	4,48				
892	USD Applied Materials Inc	144 566	1,36				
7 086	USD Bank of America Corp	238 586	2,25				
2 059	USD BioMarin Pharmaceutical Inc	198 529	1,87				
296	USD Broadcom Inc	330 410	3,11				
753	USD CME Group Inc	158 582	1,49				
1 724	USD ConocoPhillips	200 105	1,89				
197	USD Costco Wholesale Corp	130 036	1,22				
549	USD Eaton Corp PLC	132 210	1,25				
459	USD Humana Inc	210 135	1,98				
738	USD IQVIA Holdings Inc	170 758	1,61				
1 604	USD Johnson & Johnson	251 411	2,37				
9 927	USD Kenvue Inc	213 728	2,01				
544	USD Mastercard Inc	232 021	2,19				
2 456	USD Merck & Co Inc	267 753	2,52				
1 107	USD Meta Platforms Inc	391 834	3,69				
2 235	USD Microsoft Corp	840 449	7,92				
3 498	USD NextEra Energy Inc	212 468	2,00				
1 051	USD Nvidia Corp	520 476	4,90				
1 991	USD On Semiconductor Corp	166 308	1,57				
548	USD Parker-Hannifin Corp	252 464	2,38				
1 101	USD Ross Stores Inc	152 367	1,44				
521	USD S&P Global Inc	229 511	2,16				
956	USD Salesforce Inc	251 562	2,37				
3 492	USD Schlumberger NV	181 724	1,71				
1 280	USD Target Corp	182 298	1,72				
547	USD Thermo Fisher Scientific Inc	290 342	2,74				
436	USD United Rentals Inc	250 011	2,36				
443	USD UnitedHealth Group Inc	233 226	2,20				
289	USD Vertex Pharmaceuticals Inc	117 591	1,11				

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Actions ordinaires et préférentielles – 94,25 %				Actions ordinaires et préférentielles – 94,25 % <i>(suite)</i>			
Îles Caïmans				Hong Kong			
25 500	HKDLi Ning Co Ltd	68 252	1,05	22 000	HKD AIA Group Ltd	191 725	2,95
Îles Caïmans – Total				3 500 HKD Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd			
Chine				Hong-Kong – Total			
3 591	CNY3peak Inc	73 781	1,14			311 850	4,80
37 600	HKDALibaba Group Holding Ltd	364 032	5,60	Total des actions ordinaires et préférentielles			
23 400	HKDANTA Sports Products Ltd	227 001	3,49	6 125 387			
8 900	HKDBaidu Inc	132 328	2,04	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			
1 343	USDBaidu Inc-ADR	159 938	2,46	6 125 387			
427 000	HKDBank of China Ltd	162 957	2,51	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			
7 500	HKDBYD Co Ltd	205 928	3,17	6 125 387			
478 000	HKDChina Construction Bank Corp	284 650	4,38	Autres actifs/(passifs) nets			
76 000	HKDChina Merchants Bank Co Ltd	264 735	4,07	373 975			
15 700	CNYChina Yangtze Power Co Ltd	51 462	0,79	TOTAL DES ACTIFS NETS			
2 880	CNYContemporary Amperex Technology Co Ltd	66 032	1,02	6 499 362			
7 300	CNYGigaDevice Semiconductor Inc	94 718	1,46	100,00			
46 000	HKDGreat Wall Motor Co Ltd	59 735	0,92				
16 600	HKDHaier Smart Home Co Ltd	46 876	0,72				
8 600	CNYHundsun Technologies Inc	34 735	0,53				
12 000	HKDInnovent Biologics Inc	65 697	1,01				
18 050	HKDJD.com Inc	260 052	4,00				
2 026	USDJD.com Inc-ADR	58 531	0,90				
4 100	CNYJiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	31 484	0,48				
2 800	USDKanzhun Ltd	46 508	0,72				
1 100	CNYKweichow Moutai Co Ltd	266 635	4,10				
5 100	CNYMaxscend Microelectronics Co Ltd	100 989	1,55				
9 750	HKDMeituan	102 263	1,57				
18 500	CNYMidea Group Co Ltd	141 934	2,18				
11 800	HKDNetEase Inc	212 470	3,27				
2 500	USDPDD Holdings Inc-ADR	365 775	5,63				
41 000	HKDPing An Insurance Group Co of China Ltd	185 611	2,86				
10 425	CNYSG Micro Corp	130 316	2,01				
17 300	CNYShenzhen Inovance Technology Co Ltd	153 403	2,36				
7 100	CNYShenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	289 759	4,46				
3 100	HKDShenzhou International Group Holdings Ltd	31 919	0,49				
15 400	HKDTencent Holdings Ltd	579 037	8,91				
35 300	CNYVenustech Group Inc	133 851	2,06				
5 700	CNYWuliangye Yibin Co Ltd	112 317	1,73				
14 600	HKDWuXi AppTec Co Ltd	148 551	2,29				
9 000	HKDWuxi Biologics Cayman Inc	34 116	0,52				
40 000	HKDZijin Mining Group Co Ltd	65 159	1,00				
Chine – Total				5 745 285			
				88,40			

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 %				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)			
Argentine				Danemark			
	82 USD MercadoLibre Inc	128 866	0,06		1 185 DKK Danske Bank A/S	31 678	0,02
Argentine – Total					14 966 DKK Novo Nordisk A/S	1 548 195	0,73
		128 866	0,06		3 177 DKK Novozymes A/S	174 707	0,08
Australie					34 972 DKK Vestas Wind Systems A/S	1 110 568	0,52
	8 130 AUD Ampol Ltd	200 542	0,09	Danemark – Total			
	9 114 AUD ANZ Group Holdings Ltd	161 195	0,08			2 865 148	1,35
	427 AUD Aristocrat Leisure Ltd	11 894	0,01	Finlande			
	288 USD Atlassian Corp	68 504	0,03		9 304 EUR Kesko Oyj	184 227	0,09
	1 320 AUD Brambles Ltd	12 250	0,01		14 651 EUR Neste Oyj	521 294	0,24
	2 324 AUD Coles Group Ltd	25 547	0,01		24 404 EUR Nordea Bank Abp	302 629	0,14
	11 148 AUD Commonwealth Bank of Australia	850 444	0,40	Finlande – Total			
	886 AUD CSL Ltd	173 298	0,08			1 008 150	0,47
	8 021 AUD Endeavour Group Ltd	28 515	0,01	France			
	5 707 AUD Goodman Group REIT	98 523	0,05		10 140 EUR Alstom SA	136 430	0,06
	21 076 AUD IGO Ltd	130 150	0,06		13 178 EUR AXA SA	429 288	0,20
	38 967 AUD Insurance Australia Group Ltd	150 494	0,07		2 468 EUR BNP Paribas SA	170 638	0,08
	2 672 AUD Macquarie Group Ltd	334 801	0,16		5 428 EUR Bouygues SA	204 585	0,10
	19 970 AUD National Australia Bank Ltd	418 334	0,20		127 EUR Capgemini SE	26 480	0,01
	98 977 AUD Pilbara Minerals Ltd	266 771	0,13		5 606 EUR Carrefour SA	102 582	0,05
	30 464 AUD QBE Insurance Group Ltd	307 857	0,14		350 EUR Edenred SE	20 932	0,01
	871 AUD Sonic Healthcare Ltd	19 066	0,01		732 EUR Gecina SA REIT	89 027	0,04
	13 123 AUD Stockland REIT	39 847	0,02		12 544 EUR Getlink SE	229 537	0,11
	34 932 AUD Suncorp Group Ltd	330 126	0,15		335 EUR Kering SA	147 653	0,07
	28 101 AUD Westpac Banking Corp	439 101	0,21		132 EUR La Francaise des Jeux SAEM	4 789	0,00
	14 520 AUD Woolworths Group Ltd	368 567	0,17		2 405 EUR L'Oreal SA	1 197 234	0,56
Australie – Total					1 236 EUR Publicis Groupe SA	114 689	0,05
		4 435 826	2,09		4 833 EUR Renault SA	197 028	0,09
Autriche					3 422 EUR Sanofi SA	339 303	0,16
	143 EUR Verbund AG	13 277	0,01		18 860 EUR Schneider Electric SE	3 787 150	1,78
Autriche – Total					616 EUR Societe Generale SA	16 348	0,01
		13 277	0,01		314 EUR Sodexo SA	34 554	0,02
Belgique					7 414 EUR TotalEnergies SE	504 496	0,24
	507 EUR KBC Group NV	32 887	0,02		668 EUR Worldline SA	11 563	0,01
	545 EUR Ucb SA	47 500	0,02	France – Total			
	7 271 EUR Umicore SA	199 995	0,09			7 764 306	3,65
Belgique – Total				Allemagne			
		280 382	0,13		477 EUR adidas AG	97 037	0,04
Bermudes					1 477 EUR Allianz SE	394 758	0,19
	1 130 USD Arch Capital Group Ltd	83 925	0,04		1 732 EUR Commerzbank AG	20 587	0,01
	247 USD Everest Group Ltd	87 335	0,04		9 559 EUR Deutsche Bank AG	130 556	0,06
	2 091 USD Liberty Global Ltd	38 976	0,02		81 334 EUR Deutsche Telekom AG	1 954 142	0,92
Bermudes – Total					1 873 EUR GEA Group AG	77 981	0,04
		210 236	0,10		1 244 EUR Hellofresh SE	19 665	0,01
Canada					1 328 EUR Henkel AG & Co KGaA	95 324	0,04
	15 072 CAD Cameco Corp	653 013	0,31		2 103 EUR Henkel AG & Co KGaA–Preferred Stock	169 259	0,08
	19 683 CAD Canadian National Railway Co	2 486 125	1,17		956 EUR MTU Aero Engines AG	206 193	0,10
	29 246 CAD Canadian Pacific Kansas City Ltd	2 325 308	1,09		290 EUR Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	120 163	0,06
	40 825 CAD Enbridge Inc	1 476 833	0,69		5 344 EUR Porsche Automobil Holding SE–Preferred Stock	273 438	0,13
	5 486 CAD Franco-Nevada Corp	610 633	0,29		5 980 EUR SAP SE	921 378	0,43
	5 321 CAD Hydro One Ltd	160 203	0,08				
	853 USD Lululemon Athletica Inc	436 130	0,20				
	4 888 CAD Parkland Corp	158 324	0,07				
	992 CAD Shopify Inc	77 609	0,04				
	3 858 CAD Stantec Inc	311 250	0,15				
	15 679 CAD Wheaton Precious Metals Corp	777 291	0,37				
Canada – Total							
		9 472 719	4,46				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)				
Allemagne (suite)				Japon (suite)				
696 EUR	Siemens AG	130 641	0,06	12 500 JPY	Nippon Telegraph & Telephone Corp	15 277	0,01	
390 EUR	Zalando SE	9 241	0,00	7 700 JPY	Nomura Holdings Inc	34 830	0,02	
Allemagne – Total				20 700 JPY NTT Data Group Corp				
4 620 363				293 512				
2,17				19 100 JPY Obayashi Corp				
Hong Kong				10 600 JPY Odakyu Electric Railway Co Ltd				
52 800 HKD	AIA Group Ltd	460 142	0,22	900 JPY	Olympus Corp	13 026	0,01	
8 135 HKD	Hang Seng Bank Ltd	94 857	0,04	11 200 JPY	Ono Pharmaceutical Co Ltd	199 881	0,09	
50 508 HKD	Henderson Land Development Co Ltd	155 563	0,07	1 400 JPY	Recruit Holdings Co Ltd	59 215	0,03	
385 000 HKD	Hong Kong & China Gas Co Ltd	294 843	0,14	13 200 JPY	Sekisui Chemical Co Ltd	190 304	0,09	
1 000 HKD	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	34 321	0,02	13 100 JPY	Sekisui House Ltd	291 029	0,14	
55 500 HKD	MTR Corp Ltd	215 360	0,10	3 200 JPY	Seven & i Holdings Co Ltd	126 997	0,06	
47 500 HKD	Power Assets Holdings Ltd	275 259	0,13	2 800 JPY	Shimano Inc	433 664	0,20	
Hong-Kong – Total				10 600 JPY Shimizu Corp				
1 530 345				70 421				
0,72				1 900 JPY Shionogi & Co Ltd				
Irlande				4 800 JPY Shiseido Co Ltd				
4 583 USD	Accenture PLC	1 608 220	0,76	4 200 JPY	Sompo Holdings Inc	205 442	0,10	
8 255 USD	Medtronic PLC	680 047	0,32	3 509 JPY	Sony Group Corp	333 776	0,16	
Irlande – Total				3 100 JPY Sumitomo Mitsui Financial Group Inc				
2 288 267				151 284				
1,08				600 JPY Sysmex Corp				
Ile de Man				5 500 JPY Takeda Pharmaceutical Co Ltd				
2 139 GBP	Entain PLC	27 110	0,01	4 500 JPY	Terumo Corp	147 532	0,07	
Ile de Man – Total				6 000 JPY Tobu Railway Co Ltd				
27 110				161 257				
0,01				6 900 JPY Tokio Marine Holdings Inc				
Italie				16 458 JPY Tokyo Electron Ltd				
12 544 EUR	Intesa Sanpaolo SpA	36 630	0,02	14 600 JPY	Tokyu Corp	178 228	0,08	
202 EUR	Nexi SpA	1 653	0,00	4 600 JPY	TOTO Ltd	121 151	0,06	
359 EUR	UniCredit SpA	9 742	0,00	19 100 JPY	Toyota Motor Corp	350 961	0,16	
Italie – Total				700 JPY USS Co Ltd				
48 025				14 081				
0,02				7 600 JPY West Japan Railway Co				
Japon				9 100 JPY Yaskawa Electric Corp				
400 JPY	Advantest Corp	13 610	0,01	Japon – Total			13 927 677	6,55
22 300 JPY	Aeon Co Ltd	498 420	0,23	Jersey				
14 000 JPY	Astellas Pharma Inc	167 428	0,08	7 065 USD	Ferguson PLC	1 364 040	0,64	
3 900 JPY	Azbil Corp	129 078	0,06	Jersey – Total				
25 000 JPY	Central Japan Railway Co	635 551	0,30	1 364 040				
1 400 JPY	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	53 049	0,02	Pays-Bas				
4 900 JPY	Dai-ichi Life Holdings Inc	103 992	0,05	10 836 EUR	ABN AMRO Bank NV	162 672	0,08	
5 400 JPY	Daiichi Sankyo Co Ltd	148 310	0,07	49 EUR	Adyen NV	63 146	0,03	
440 JPY	Daito Trust Construction Co Ltd	51 029	0,02	7 624 EUR	Aegon Ltd	44 198	0,02	
20 700 JPY	Daiwa House Industry Co Ltd	627 255	0,29	5 924 EUR	Akzo Nobel NV	489 618	0,23	
42 412 JPY	Denso Corp	639 880	0,30	1 212 EUR	ASML Holding NV	912 684	0,43	
4 900 JPY	Dentsu Group Inc	125 750	0,06	4 523 EUR	Heineken Holding NV	382 719	0,18	
10 500 JPY	East Japan Railway Co	605 437	0,28	29 963 EUR	ING Groep NV	447 692	0,21	
428 JPY	Eisai Co Ltd	21 409	0,01	10 055 EUR	Koninklijke Ahold Delhaize NV	288 955	0,13	
100 300 JPY	ENEOS Holdings Inc	398 696	0,19	4 211 EUR	Koninklijke Philips NV	98 081	0,05	
300 JPY	Fujitsu Ltd	45 272	0,02	5 066 EUR	NN Group NV	200 063	0,09	
4 400 JPY	Keisei Electric Railway Co Ltd	207 984	0,10	2 902 EUR	Prosus NV	86 506	0,04	
2 600 JPY	Lasertec Corp	685 502	0,32	Pays-Bas – Total			3 176 334	1,49
1 200 JPY	LY Corp	4 253	0,00					
19 200 JPY	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	164 994	0,08					
13 600 JPY	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	535 009	0,25					
1 700 JPY	NEC Corp	100 688	0,05					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)			
Nouvelle-Zélande				Suisse (suite)			
12 630	NZD Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	188 722	0,09	1 009	CHF Julius Baer Group Ltd	56 525	0,03
24 397	NZD Mercury NZ Ltd	101 950	0,05	5 679	CHF Logitech International SA	538 177	0,25
45 187	NZD Meridian Energy Ltd	158 500	0,07	7 305	CHF Novartis AG	736 619	0,35
44 430	NZD Spark New Zealand Ltd	145 718	0,07	29	CHF Partners Group Holding AG	41 795	0,02
Nouvelle-Zélande – Total			0,28	3 126	CHF Roche Holding AG	908 106	0,43
Norvège				18 059	EUR Siemens Energy AG	239 387	0,11
3 738	NOK DNB Bank ASA	79 503	0,04	86	CHF Sika AG	27 967	0,01
15 949	NOK Equinor ASA	505 920	0,24	152	CHF Sonova Holding AG	49 556	0,02
2 971	NOK Kongsberg Gruppen ASA	136 150	0,06	68	CHF Swiss Life Holding AG	47 184	0,02
16 149	NOK Mowi ASA	289 406	0,13	2 989	CHF Swiss Re AG	335 816	0,16
2 609	NOK Salmar ASA	146 228	0,07	880	CHF Swisscom AG	529 056	0,25
Norvège – Total			0,54	1 904	CHF Zurich Insurance Group AG	994 473	0,47
Portugal				Suisse – Total			
15 825	EUR Galp Energia SGPS SA	233 198	0,11	6 140 948			
7 559	EUR Jeronimo Martins SGPS SA	192 385	0,09	Royaume-Uni			
Portugal – Total			0,20	5 315	GBP 3i Group PLC	164 036	0,08
Singapour				13 128	GBP abrdn PLC	29 898	0,01
32 300	SGD Singapore Technologies Engineering Ltd	95 252	0,04	703	USD Aon PLC	204 587	0,10
158 227	SGD Singapore Telecommunications Ltd	296 278	0,14	4 493	GBP Astrazeneca PLC	607 134	0,29
Singapour – Total			0,18	3 831	GBP Aviva PLC	21 230	0,01
Espagne				66 332	GBP Barclays PLC	130 036	0,06
840	EUR Acciona SA	123 690	0,06	33 238	GBP Barratt Developments PLC	238 384	0,11
7 222	EUR ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	320 388	0,15	3 722	GBP Berkeley Group Holdings PLC	222 436	0,10
575	EUR Amadeus IT Group SA	41 210	0,02	27 649	GBP BT Group PLC	43 565	0,02
71 801	EUR Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	652 445	0,31	3 543	GBP Bunzl PLC	144 080	0,07
44 083	EUR CaixaBank SA	181 442	0,09	1 977	GBP Burberry Group PLC	35 687	0,02
952	EUR Corp ACCIONA Energias Renovables SA	29 530	0,01	5 800	USD Coca-Cola Europacific Partners PLC	387 092	0,18
10 793	EUR EDP Renovaveis SA	220 864	0,10	4 179	GBP Compass Group PLC	114 326	0,05
824	EUR Industria de Diseno Textil SA	35 890	0,02	3 037	GBP Experian PLC	123 968	0,06
45 868	EUR Telefonica SA	179 061	0,08	16 541	GBP GSK PLC	305 796	0,14
Espagne – Total			0,84	79 492	GBP HSBC Holdings PLC	643 993	0,30
Suède				3 197	GBP Imperial Brands PLC	73 625	0,03
12 189	SEK H & M Hennes & Mauritz AB	213 619	0,10	1 971	GBP Informa PLC	19 629	0,01
2 555	SEK Industrivarden AB	83 385	0,04	1 102	GBP J Sainsbury PLC	4 251	0,00
2 316	SEK Indutrade AB	60 164	0,03	664	GBP Kingfisher PLC	2 059	0,00
52 690	SEK Nibe Industrier AB	370 163	0,18	24 904	GBP Land Securities Group PLC REIT	223 757	0,11
22 133	SEK Skandinaviska Enskilda Banken AB	304 833	0,14	15 791	GBP Legal & General Group PLC	50 547	0,02
11 859	SEK Svenska Handelsbanken AB	128 794	0,06	84 609	GBP Lloyds Banking Group PLC	51 460	0,02
1 976	SEK Swedbank AB	39 862	0,02	1 179	GBP London Stock Exchange Group PLC	139 387	0,07
2 418	SEK Volvo AB	64 062	0,03	1 991	GBP M&G PLC	5 645	0,00
Suède – Total			0,60	19 676	GBP NatWest Group PLC	55 032	0,03
Suisse				1 627	GBP Pearson PLC	19 998	0,01
3 032	USD Chubb Ltd	685 232	0,32	11 288	GBP Persimmon PLC	199 876	0,09
1 648	CHF Cie Financiere Richemont SA	226 645	0,11	3 333	GBP Prudential PLC	37 696	0,02
175	CHF Givaudan SA	724 410	0,34	4 467	GBP Reckitt Benckiser Group PLC	308 644	0,15
				11 842	GBP RELX PLC	469 491	0,22
				40 150	GBP Rolls-Royce Holdings PLC	153 396	0,07
				5 121	GBP Segro PLC REIT	57 866	0,03
				9 373	GBP Severn Trent PLC	308 157	0,14
				16 556	GBP Standard Chartered PLC	140 690	0,07
				147 455	GBP Tesco PLC	546 069	0,26

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)			
Royaume-Uni (suite)				États-Unis (suite)			
23 582	GBP United Utilities Group PLC	318 510	0,15	537	USD Broadridge Financial Solutions Inc	110 488	0,05
32 551	GBP Wpp PLC	312 465	0,15	2 603	USD Capital One Financial Corp	341 305	0,16
Royaume-Uni – Total				États-Unis – Total			
6 914 498				3,25			
États-Unis				États-Unis			
6 942	USD AbbVie Inc	1 075 802	0,51	4 544	USD Carlyle Group Inc	184 895	0,09
2 421	USD Adobe Inc	1 444 369	0,68	10 002	USD Cbre Group Inc	931 086	0,44
4 625	USD Advanced Micro Devices Inc	681 771	0,32	2 162	USD Cencora Inc	444 032	0,21
2 464	USD AECOM	227 748	0,11	2 039	USD Centene Corp	151 314	0,07
11 897	USD Aflac Inc	981 502	0,46	4 665	USD Charles Schwab Corp	320 952	0,15
2 450	USD Agilent Technologies Inc	340 623	0,16	1 024	USD Cheniere Energy Inc	174 807	0,08
742	USD Airbnb Inc	101 016	0,05	94	USD Chipotle Mexican Grill Inc	214 974	0,10
5 666	USD Alexandria Real Estate Equities Inc REIT	718 279	0,34	185	USD Church & Dwight Co Inc	17 494	0,01
1 366	USD Allstate Corp	191 213	0,09	2 597	USD Cigna Group	777 672	0,37
25 684	USD Alphabet Inc	3 619 646	1,70	404	USD Cincinnati Financial Corp	41 798	0,02
20 210	USD Alphabet Inc	2 823 135	1,33	83 862	USD Cisco Systems Inc	4 236 708	1,99
5 663	USD Altria Group Inc	228 445	0,11	9 361	USD Citigroup Inc	481 530	0,23
34 647	USD Amazon.com Inc	5 264 265	2,48	1 600	USD Citizens Financial Group Inc	53 024	0,02
4 765	USD American Express Co	892 675	0,42	525	USD Cloudflare Inc	43 711	0,02
15	USD American Financial Group Inc	1 783	0,00	741	USD CME Group Inc	156 055	0,07
5 057	USD American International Group Inc	342 612	0,16	13 431	USD Coca-Cola Co	791 489	0,37
6 765	USD American Water Works Co Inc	892 912	0,42	356	USD Cognizant Technology Solutions Corp	26 889	0,01
558	USD Ameriprise Financial Inc	211 945	0,10	739	USD Coinbase Global Inc	128 527	0,06
2 171	USD Amgen Inc	625 291	0,29	6 885	USD Colgate-Palmolive Co	548 803	0,26
6 807	USD Annaly Capital Management Inc	131 852	0,06	17 398	USD Comcast Corp	762 902	0,36
483	USD Apollo Global Management Inc	45 011	0,02	502	USD CoStar Group Inc	43 870	0,02
54 300	USD Apple Inc	10 454 379	4,92	2 477	USD Costco Wholesale Corp	1 635 018	0,77
2 355	USD Applied Materials Inc	381 675	0,18	115	USD CrowdStrike Holdings Inc	29 362	0,01
551	USD Ares Management Corp	65 525	0,03	1 140	USD Crown Castle Inc REIT	131 317	0,06
264	USD Assurant Inc	44 481	0,02	70 716	USD CSX Corp	2 451 724	1,15
23 701	USD AT&T Inc	397 703	0,19	8 257	USD CVS Health Corp	651 973	0,31
3 162	USD Autodesk Inc	769 884	0,36	2 333	USD Danaher Corp	539 716	0,25
1 471	USD Automatic Data Processing Inc	342 699	0,16	414	USD DaVita Inc	43 371	0,02
46	USD AutoZone Inc	118 938	0,06	2 930	USD Dell Technologies Inc	224 145	0,11
4 936	USD AvalonBay Communities Inc REIT	924 118	0,43	389	USD Dexcom Inc	48 271	0,02
17 837	USD Baker Hughes Co	609 669	0,29	329	USD Dollar General Corp	44 728	0,02
10 917	USD Ball Corp	627 946	0,30	56	USD Dollar Tree Inc	7 955	0,00
32 448	USD Bank of America Corp	1 092 524	0,51	616	USD DraftKings Inc	21 714	0,01
2 422	USD Bank of New York Mellon Corp	126 065	0,06	2 791	USD eBay Inc	121 743	0,06
1 307	USD Becton Dickinson and Co	318 686	0,15	4 241	USD Ecolab Inc	841 202	0,40
3 906	USD Best Buy Co Inc	305 762	0,14	1 852	USD Edwards Lifesciences Corp	141 215	0,07
1 003	USD Biogen Inc	259 546	0,12	1 924	USD Elevance Health Inc	907 281	0,43
474	USD BlackRock Inc	384 793	0,18	2 606	USD Eli Lilly & Co	1 519 090	0,71
423	USD Blackstone Inc	55 379	0,03	4 719	USD Enphase Energy Inc	623 569	0,29
1 762	USD Block Inc	136 291	0,06	5 019	USD Entegris Inc	601 377	0,28
156	USD Booking Holdings Inc	553 366	0,26	421	USD Equitable Holdings Inc	14 019	0,01
773	USD Booz Allen Hamilton Holding Corp	98 874	0,05	502	USD Equity Residential REIT	30 702	0,01
5 739	USD BorgWarner Inc	205 743	0,10	9 857	USD Essential Utilities Inc	368 159	0,17
667	USD Boston Properties Inc REIT	46 803	0,02	3 744	USD Estee Lauder Cos Inc	547 560	0,26
12 919	USD Boston Scientific Corp	746 847	0,35	1 311	USD Etsy Inc	106 257	0,05
13 368	USD Bristol-Myers Squibb Co	685 912	0,32	5 163	USD Eversource Energy	318 660	0,15
444	USD Broadcom Inc	495 615	0,23	285	USD Expedia Group Inc	43 260	0,02

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
189	USD Fidelity National Information Services Inc	11 353	0,01	10 331	USD MetLife Inc	683 189	0,32
7 863	USD Fifth Third Bancorp	271 195	0,13	25 751	USD Microsoft Corp	9 683 406	4,55
3 513	USD First Solar Inc	605 220	0,28	241	USD Moderna Inc	23 967	0,01
1 466	USD Fiserv Inc	194 743	0,09	247	USD MongoDB Inc	100 986	0,05
2 422	USD FMC Corp	152 707	0,07	1 749	USD Moody's Corp	683 089	0,32
9 181	USD Ford Motor Co	111 916	0,05	5 632	USD Morgan Stanley	525 184	0,25
2 002	USD Franklin Resources Inc	59 640	0,03	311	USD MSCI Inc	175 917	0,08
2 710	USD GE HealthCare Technologies Inc	209 537	0,10	1 169	USD Nasdaq Inc	67 966	0,03
716	USD Gen Digital Inc	16 339	0,01	1 520	USD Netflix Inc	740 058	0,35
15 113	USD General Electric Co	1 928 872	0,91	1 181	USD News Corp	28 994	0,01
1 557	USD General Motors Co	55 927	0,03	7 223	USD NIKE Inc	784 201	0,37
5 055	USD Gilead Sciences Inc	409 506	0,19	4 242	USD Norfolk Southern Corp	1 002 724	0,47
795	USD Global Payments Inc	100 965	0,05	1 685	USD Northern Trust Corp	142 180	0,07
2 190	USD Goldman Sachs Group Inc	844 836	0,40	8 081	USD Nvidia Corp	4 001 873	1,88
55	USD Hasbro Inc	2 808	0,00	3 143	USD Omnicom Group Inc	271 901	0,13
126	USD Henry Schein Inc	9 539	0,00	12 327	USD ONEOK Inc	865 602	0,41
43 622	USD Hewlett Packard Enterprise Co	740 702	0,35	7 170	USD Oracle Corp	755 933	0,36
2 331	USD Hologic Inc	166 550	0,08	2 696	USD Palantir Technologies Inc	46 290	0,02
4 477	USD Home Depot Inc	1 551 504	0,73	1 075	USD Palo Alto Networks Inc	316 996	0,15
3 632	USD HP Inc	109 287	0,05	1 804	USD Paramount Global	26 681	0,01
975	USD Humana Inc	446 365	0,21	4 983	USD PayPal Holdings Inc	306 006	0,14
876	USD IDEXX Laboratories Inc	486 224	0,23	22 447	USD Pfizer Inc	646 249	0,30
356	USD Illumina Inc	49 569	0,02	5 417	USD Philip Morris International Inc	509 631	0,24
158	USD Insulet Corp	34 283	0,02	3 977	USD Phillips 66	529 498	0,25
1 079	USD Intel Corp	54 220	0,03	1 637	USD PNC Financial Services Group Inc	253 489	0,12
5 736	USD International Business Machines Corp	938 123	0,44	4 222	USD Principal Financial Group Inc	332 145	0,16
1 201	USD Interpublic Group of Cos Inc	39 201	0,02	5 272	USD Procter & Gamble Co	772 559	0,36
1 655	USD Intuit Inc	1 034 425	0,49	1 720	USD Progressive Corp	273 962	0,13
1 010	USD IQVIA Holdings Inc	233 694	0,11	8 618	USD Prologis Inc REIT	1 148 779	0,54
2 366	USD Iron Mountain Inc REIT	165 573	0,08	8 965	USD Prudential Financial Inc	929 760	0,44
7 144	USD Johnson & Johnson	1 119 751	0,53	258	USD PTC Inc	45 140	0,02
12 066	USD JPMorgan Chase & Co	2 052 427	0,97	3 096	USD PulteGroup Inc	319 569	0,15
10 997	USD Juniper Networks Inc	324 192	0,15	3 500	USD Qualcomm Inc	506 205	0,24
1 140	USD Kenvue Inc	24 544	0,01	497	USD Regeneron Pharmaceuticals Inc	436 510	0,21
7 014	USD KeyCorp	101 002	0,05	2 966	USD Regions Financial Corp	57 481	0,03
809	USD Keysight Technologies Inc	128 704	0,06	1 851	USD Reliance Steel & Aluminum Co	517 688	0,24
642	USD KKR & Co Inc	53 190	0,02	42	USD ResMed Inc	7 225	0,00
250	USD KLA Corp	145 325	0,07	311	USD Revvity Inc	33 995	0,02
4 824	USD Kroger Co	220 505	0,10	450	USD Roblox Corp	20 574	0,01
322	USD Lam Research Corp	252 210	0,12	267	USD Ross Stores Inc	36 950	0,02
136	USD Live Nation Entertainment Inc	12 730	0,01	2 243	USD S&P Global Inc	988 086	0,46
9 226	USD LKQ Corp	440 911	0,21	7 224	USD Salesforce Inc	1 900 923	0,89
2 162	USD Lowe's Cos Inc	481 153	0,23	284	USD ServiceNow Inc	200 643	0,09
466	USD LPL Financial Holdings Inc	106 071	0,05	2 551	USD Sherwin-Williams Co	795 657	0,37
31 696	USD Lucid Group Inc	133 440	0,06	916	USD Simon Property Group Inc REIT	130 658	0,06
1 140	USD Marsh & McLennan Cos Inc	215 996	0,10	7 197	USD Snap Inc	121 845	0,06
4 424	USD Mastercard Inc	1 886 880	0,89	447	USD Snowflake Inc	88 953	0,04
4 351	USD McDonald's Corp	1 290 115	0,61	2 910	USD Starbucks Corp	279 389	0,13
917	USD McKesson Corp	424 553	0,20	1 552	USD Stryker Corp	464 762	0,22
11 838	USD Merck & Co Inc	1 290 579	0,61	10 133	USD Sysco Corp	741 026	0,35
7 733	USD Meta Platforms Inc	2 737 173	1,29	449	USD T Rowe Price Group Inc	48 353	0,02
				3 725	USD Target Corp	530 514	0,25

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 98,84 % (suite)					
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)					
18 019	USD Tesla Inc	4 477 361	2,11	259	USD W R Berkley Corp	18 316	0,01		
213	USD Texas Pacific Land Corp	334 932	0,16	6 203	USD Walgreens Boots Alliance Inc	161 960	0,08		
851	USD Thermo Fisher Scientific Inc	451 702	0,21	7 784	USD Walt Disney Co	702 817	0,33		
7 304	USD TJX Cos Inc	685 188	0,32	2 600	USD Warner Bros Discovery Inc	29 588	0,01		
2 171	USD T-Mobile US Inc	348 076	0,16	485	USD Waters Corp	159 677	0,08		
19	USD Trade Desk Inc	1 367	0,00	408	USD Workday Inc	112 632	0,05		
41	USD TransDigm Group Inc	41 476	0,02	272	USD WW Grainger Inc	225 404	0,11		
1 706	USD Travelers Cos Inc	324 976	0,15	8 678	USD Xylem Inc	992 416	0,47		
1 364	USD Truist Financial Corp	50 359	0,02	377	USD Yum! Brands Inc	49 259	0,02		
1 045	USD UDR Inc REIT	40 013	0,02	391	USD Zimmer Biomet Holdings Inc	47 585	0,02		
3 578	USD UnitedHealth Group Inc	1 883 710	0,89	États-Unis – Total			138 308 779	65,06	
3 943	USD US Bancorp	170 653	0,08	Total des actions ordinaires et préférentielles			210 143 908	98,84	
17 634	USD Verizon Communications Inc	664 802	0,31	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				210 143 908	98,84
307	USD Vertex Pharmaceuticals Inc	124 915	0,06	TOTAL DES INVESTISSEMENTS				210 143 908	98,84
253	USD VF Corp	4 756	0,00						
8 212	USD Visa Inc	2 137 994	1,01						

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – 0,07 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought AUD / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	5 874 000	3 132 971	14 212	0,01
Bought CAD / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	11 060 000	6 536 153	55 533	0,03
Bought GBP / Sold CHF, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	3 858 505	4 114 000	16 874	0,01
Bought GBP / Sold DKK, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	2 055 612	17 599 000	9 100	0,00
Bought GBP / Sold EUR, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	14 688 500	16 874 000	66 267	0,03
Bought GBP / Sold HKD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	80 065	792 000	640	0,00
Bought GBP / Sold HKD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	970 206	9 582 000	9 702	0,01
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	117 097	21 024 000	148	0,00
Bought GBP / Sold NOK, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	558 301	7 218 000	573	0,00
Bought GBP / Sold SEK, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	1 185 964	15 055 000	16 459	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	36 162 536	45 727 000	372 989	0,17
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	4 940 522	6 254 000	44 176	0,02
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Citibank NA	32 547 147	41 178 000	313 092	0,15
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	2 864 002	3 627 000	24 028	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	UBS AG	32 546 427	41 178 000	312 173	0,15
Bought GBP / Sold USD, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	2 600 332	3 284 000	30 900	0,01
Bought HKD / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	10 374 000	1 036 477	7 243	0,00
Bought ILS / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	33 000	7 147	54	0,00
Bought JPY / Sold GBP, due 04/01/24	Standard Chartered Bank	1 836 521 000	10 185 918	41 745	0,02
Bought NZD / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	821 000	406 138	2 071	0,00
Bought SGD / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	384 000	227 705	829	0,00
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	BNP Paribas SA	47 082 666	36 812 092	154 624	0,07
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	47 082 666	36 817 648	147 542	0,07
Bought USD / Sold GBP, due 03/01/24	UBS AG	47 082 668	36 809 101	158 440	0,08
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				1 799 414	0,85

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,07 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	4 114 000	3 847 125	(16 296)	(0,01)
Bought DKK / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	17 599 000	2 052 907	(9 149)	(0,01)
Bought EUR / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	16 874 000	14 673 426	(65 812)	(0,03)
Bought GBP / Sold AUD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	308 178	588 000	(8 356)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought GBP / Sold AUD, due 03/01/24	International	2 762 624	5 286 000	(85 109)	(0,04)
Bought GBP / Sold AUD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	3 135 422	5 874 000	(14 336)	(0,01)
Bought GBP / Sold CAD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	1 088 229	1 856 000	(20 303)	(0,01)
Bought GBP / Sold CAD, due 03/01/24	Merrill Lynch International	5 350 671	9 204 000	(159 209)	(0,08)
Bought GBP / Sold CAD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	6 538 003	11 060 000	(55 409)	(0,03)
Bought GBP / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	379 083	416 000	(11 012)	(0,00)
Bought GBP / Sold CHF, due 03/01/24	Merrill Lynch International	3 351 666	3 698 000	(121 048)	(0,06)
Bought GBP / Sold DKK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	241 354	2 085 000	(1 287)	(0,00)
Bought GBP / Sold DKK, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	1 800 143	15 514 000	(4 110)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Barclays Bank PLC	268 914	313 000	(2 944)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	BNP Paribas SA	1 839 477	2 132 000	(10 149)	(0,00)
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Deutsche Bank AG	447 705	517 000	(370)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	International	11 880 114	13 744 000	(37 546)	(0,02)
	Westpac Banking				
Bought GBP / Sold EUR, due 03/01/24	Corporation	144 228	168 000	(1 719)	(0,00)
Bought GBP / Sold HKD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	1 037 077	10 374 000	(7 163)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 03/01/24	Merrill Lynch International	7 047	33 000	(181)	(0,00)
Bought GBP / Sold ILS, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	7 150	33 000	(54)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	BNP Paribas SA	1 273 267	237 160 000	(59 056)	(0,03)
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Merrill Lynch International	8 398 005	1 559 381 000	(355 178)	(0,17)
	Westpac Banking				
Bought GBP / Sold JPY, due 04/01/24	Corporation	102 649	18 956 000	(3 601)	(0,00)
Bought GBP / Sold JPY, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	10 231 020	1 836 521 000	(39 498)	(0,02)
Bought GBP / Sold NOK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	130 972	1 786 000	(8 899)	(0,00)
Bought GBP / Sold NOK, due 03/01/24	Merrill Lynch International	401 936	5 432 000	(22 484)	(0,01)
Bought GBP / Sold NZD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	103 416	212 000	(2 393)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought GBP / Sold NZD, due 03/01/24	International	296 067	609 000	(8 161)	(0,00)
Bought GBP / Sold NZD, due 02/02/24	Standard Chartered Bank	406 125	821 000	(2 062)	(0,00)
Bought GBP / Sold SEK, due 03/01/24	BNP Paribas SA	143 109	1 896 000	(5 700)	(0,00)
	Goldman Sachs				
Bought GBP / Sold SEK, due 03/01/24	International	997 295	13 159 000	(34 383)	(0,02)
Bought GBP / Sold SGD, due 03/01/24	Royal Bank of Canada	227 558	384 000	(1 017)	(0,00)
Bought GBP / Sold SGD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	227 973	384 000	(834)	(0,00)
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	462 391	591 000	(1 448)	(0,00)
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	36 806 366	47 082 666	(154 232)	(0,07)
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Deutsche Bank AG	36 811 833	47 082 666	(147 261)	(0,07)
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	UBS AG	36 803 346	47 082 668	(158 084)	(0,08)
Bought NOK / Sold GBP, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	7 218 000	557 965	(560)	(0,00)
Bought SEK / Sold GBP, due 03/01/24	Standard Chartered Bank	15 055 000	1 184 745	(16 442)	(0,01)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(1 652 855)	(0,78)
Total des contrats de change à terme – couverture				146 559	0,07

Tableau des investissements (suite)

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats à terme standardisés – 0,00 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
S&P EMINI INDEX FUTURE, due 15/03/24	USD	7	1 687 000	3 025	0,00
TOPIX INDEX FUTURE, due 07/03/24	JPY	2	335 651	709	0,00
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			2 022 651	3 734	0,00
Total des contrats à terme standardisés			2 022 651	3 734	0,00
Autres actifs/(passifs) nets				2 310 868	1,09
TOTAL DES ACTIFS NETS				212 605 069	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Barclays Capital Inc. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 94 487 USD détenus en espèces chez Barclays Capital Inc.

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (<i>suite</i>)			
Actions ordinaires et préférentielles – 100,06 %				Actions ordinaires et préférentielles – 100,06 % (<i>suite</i>)			
Argentine				États-Unis (<i>suite</i>)			
	4 USD MercadoLibre Inc	6 286	0,03	201 USD Apollo Global Management Inc	18 731	0,10	
Argentine – Total		6 286	0,03	6 617 USD Apple Inc	1 273 971	7,10	
Australie				358 USD Applied Materials Inc	58 021	0,32	
	19 USD Atlassian Corp	4 519	0,03	4 512 USD AT&T Inc	75 711	0,42	
Australie – Total		4 519	0,03	254 USD Autodesk Inc	61 844	0,35	
Bermudes				172 USD Automatic Data Processing Inc	40 071	0,22	
	89 USD Arch Capital Group Ltd	6 610	0,04	4 USD AutoZone Inc	10 342	0,06	
	22 USD Everest Group Ltd	7 779	0,04	597 USD AvalonBay Communities Inc REIT	111 770	0,62	
	604 USD Liberty Global Ltd	11 258	0,06	3 081 USD Baker Hughes Co	105 309	0,59	
Bermudes – Total		25 647	0,14	1 305 USD Ball Corp	75 064	0,42	
Canada				4 106 USD Bank of America Corp	138 249	0,77	
	60 USD Lululemon Athletica Inc	30 677	0,17	558 USD Bank of New York Mellon Corp	29 044	0,16	
	1 102 USD Waste Connections Inc	164 496	0,92	196 USD Baxter International Inc	7 577	0,04	
Canada – Total		195 173	1,09	250 USD Becton Dickinson and Co	60 958	0,34	
Irlande				105 USD Best Buy Co Inc	8 219	0,05	
	410 USD Accenture PLC	143 873	0,80	92 USD Biogen Inc	23 807	0,13	
	890 USD Medtronic PLC	73 318	0,41	47 USD BlackRock Inc	38 155	0,21	
Irlande – Total		217 191	1,21	130 USD Block Inc	10 056	0,06	
Jersey				23 USD Booking Holdings Inc	81 586	0,46	
	867 USD Ferguson PLC	167 392	0,93	238 USD Booz Allen Hamilton Holding Corp	30 443	0,17	
Jersey – Total		167 392	0,93	997 USD BorgWarner Inc	35 742	0,20	
Suisse				1 354 USD Boston Scientific Corp	78 275	0,44	
	347 USD Chubb Ltd	78 422	0,44	1 201 USD Bristol-Myers Squibb Co	61 623	0,34	
Suisse – Total		78 422	0,44	146 USD Broadcom Inc	162 973	0,91	
Royaume-Uni				130 USD Broadridge Financial Solutions Inc	26 748	0,15	
	222 USD Aon PLC	64 607	0,36	77 USD Cadence Design Systems Inc	20 972	0,12	
Royaume-Uni – Total		64 607	0,36	180 USD Capital One Financial Corp	23 602	0,13	
États-Unis				138 USD Cardinal Health Inc	13 910	0,08	
	428 USD Abbott Laboratories	47 110	0,26	210 USD Carlisle Cos Inc	65 610	0,37	
	920 USD AbbVie Inc	142 572	0,79	17 USD Cboe Global Markets Inc	3 036	0,02	
	257 USD Adobe Inc	153 326	0,85	615 USD Cbre Group Inc	57 250	0,32	
	606 USD Advanced Micro Devices Inc	89 330	0,50	274 USD Cencora Inc	56 274	0,31	
	559 USD AECOM	51 668	0,29	67 USD Centene Corp	4 972	0,03	
	352 USD Aflac Inc	29 040	0,16	20 USD Charles River Laboratories International Inc	4 728	0,03	
	256 USD Agilent Technologies Inc	35 592	0,20	559 USD Charles Schwab Corp	38 459	0,21	
	35 USD Airbnb Inc	4 765	0,03	128 USD Cheniere Energy Inc	21 851	0,12	
	326 USD Albemarle Corp	47 100	0,26	14 USD Chipotle Mexican Grill Inc	32 017	0,18	
	708 USD Alexandria Real Estate Equities Inc REIT	89 753	0,50	36 USD Church & Dwight Co Inc	3 404	0,02	
	91 USD Allstate Corp	12 738	0,07	209 USD Cigna Group	62 585	0,35	
4 683 USD Alphabet Inc		659 975	3,68	7 690 USD Cisco Systems Inc	388 499	2,17	
478 USD Alphabet Inc		66 772	0,37	1 058 USD Citigroup Inc	54 424	0,30	
1 156 USD Altria Group Inc		46 633	0,26	367 USD Citizens Financial Group Inc	12 162	0,07	
4 408 USD Amazon.com Inc		669 752	3,73	82 USD CME Group Inc	17 269	0,10	
359 USD American Express Co		67 255	0,38	2 630 USD Coca-Cola Co	154 986	0,86	
463 USD American International Group Inc		31 368	0,18	380 USD Cognizant Technology Solutions Corp	28 701	0,16	
69 USD American Tower Corp REIT		14 896	0,08	413 USD Colgate-Palmolive Co	32 920	0,18	
824 USD American Water Works Co Inc		108 760	0,61	1 796 USD Comcast Corp	78 755	0,44	
270 USD Amgen Inc		77 765	0,43	221 USD Costco Wholesale Corp	145 878	0,81	
198 USD Analog Devices Inc		39 315	0,22	174 USD Crown Castle Inc REIT	20 043	0,11	
320 USD Annaly Capital Management Inc		6 198	0,03	8 640 USD CSX Corp	299 549	1,67	
				134 USD Cummins Inc	32 102	0,18	

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Actions ordinaires et préférentielles – 100,06 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 100,06 % (suite)			
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)			
878	USD CVS Health Corp	69 327	0,39	1 371	USD Intel Corp	68 893	0,38
205	USD Danaher Corp	47 425	0,26	589	USD International Business Machines Corp	96 331	0,54
675	USD Darling Ingredients Inc	33 642	0,19	581	USD Interpublic Group of Cos Inc	18 964	0,11
137	USD DaVita Inc	14 352	0,08	134	USD Intuit Inc	83 754	0,47
13	USD Deckers Outdoor Corp	8 690	0,05	21	USD IQVIA Holdings Inc	4 859	0,03
105	USD Deere & Co	41 986	0,23	451	USD Iron Mountain Inc REIT	31 561	0,18
260	USD Dell Technologies Inc	19 890	0,11	21	USD Jack Henry & Associates Inc	3 432	0,02
87	USD Dexcom Inc	10 796	0,06	1 358	USD Johnson & Johnson	212 853	1,19
27	USD Dollar General Corp	3 671	0,02	1 468	USD JPMorgan Chase & Co	249 707	1,39
80	USD Dollar Tree Inc	11 364	0,06	1 391	USD Juniper Networks Inc	41 007	0,23
200	USD eBay Inc	8 724	0,05	321	USD Kenvue Inc	6 911	0,04
322	USD Ecolab Inc	63 869	0,36	173	USD KeyCorp	2 491	0,01
152	USD Edwards Lifesciences Corp	11 590	0,06	1 445	USD Kimco Realty Corp REIT	30 793	0,17
47	USD Electronic Arts Inc	6 430	0,04	36	USD KKR & Co Inc	2 983	0,02
233	USD Elevance Health Inc	109 873	0,61	5	USD KLA Corp	2 907	0,02
288	USD Eli Lilly & Co	167 881	0,94	795	USD Kroger Co	36 339	0,20
581	USD Enphase Energy Inc	76 773	0,43	94	USD Lam Research Corp	73 626	0,41
647	USD Entegris Inc	77 524	0,43	1 124	USD LKQ Corp	53 716	0,30
449	USD Equitable Holdings Inc	14 952	0,08	183	USD Lowe's Cos Inc	40 727	0,23
1 104	USD Essential Utilities Inc	41 234	0,23	3	USD LPL Financial Holdings Inc	683	0,00
53	USD Essex Property Trust Inc REIT	13 141	0,07	4 095	USD Lucid Group Inc	17 240	0,10
140	USD Estee Lauder Cos Inc	20 475	0,11	62	USD M&T Bank Corp	8 499	0,05
42	USD Etsy Inc	3 404	0,02	182	USD Marsh & McLennan Cos Inc	34 484	0,19
1 521	USD Eversource Energy	93 876	0,52	661	USD Mastercard Inc	281 923	1,57
73	USD Expedia Group Inc	11 081	0,06	449	USD McDonald's Corp	133 133	0,74
579	USD Exxon Mobil Corp	57 888	0,32	78	USD McKesson Corp	36 112	0,20
11	USD Fair Isaac Corp	12 804	0,07	1 359	USD Merck & Co Inc	148 158	0,83
37	USD Fidelity National Information Services Inc	2 223	0,01	919	USD Meta Platforms Inc	325 289	1,81
112	USD Fifth Third Bancorp	3 863	0,02	541	USD MetLife Inc	35 776	0,20
436	USD First Solar Inc	75 114	0,42	12	USD Mettler-Toledo International Inc	14 556	0,08
82	USD Fiserv Inc	10 893	0,06	3 116	USD Microsoft Corp	1 171 741	6,53
288	USD FMC Corp	18 158	0,10	84	USD Moderna Inc	8 354	0,05
214	USD Fortinet Inc	12 525	0,07	190	USD Moody's Corp	74 206	0,41
81	USD Fortive Corp	5 964	0,03	744	USD Morgan Stanley	69 378	0,39
265	USD GE HealthCare Technologies Inc	20 490	0,11	55	USD MSCI Inc	31 111	0,17
502	USD Gen Digital Inc	11 456	0,06	482	USD Nasdaq Inc	28 023	0,16
2 142	USD General Electric Co	273 383	1,52	211	USD Netflix Inc	102 732	0,57
735	USD Gilead Sciences Inc	59 542	0,33	703	USD News Corp	17 259	0,10
44	USD Global Payments Inc	5 588	0,03	633	USD NIKE Inc	68 725	0,38
26	USD GoDaddy Inc	2 760	0,02	960	USD Norfolk Southern Corp	226 925	1,27
205	USD Goldman Sachs Group Inc	79 083	0,44	114	USD Northern Trust Corp	9 619	0,05
48	USD Henry Schein Inc	3 634	0,02	1 001	USD Nvidia Corp	495 715	2,76
5 498	USD Hewlett Packard Enterprise Co	93 356	0,52	39	USD Okta Inc	3 531	0,02
164	USD Hologic Inc	11 718	0,07	291	USD Omnicom Group Inc	25 174	0,14
514	USD Home Depot Inc	178 127	0,99	338	USD ONEOK Inc	23 734	0,13
612	USD Host Hotels & Resorts Inc REIT	11 916	0,07	681	USD Oracle Corp	71 798	0,40
89	USD HP Inc	2 678	0,02	386	USD Owens Corning	57 217	0,32
74	USD Humana Inc	33 878	0,19	468	USD Paccar Inc	45 700	0,26
137	USD Huntington Bancshares Inc	1 743	0,01	201	USD Palantir Technologies Inc	3 451	0,02
70	USD IDEX Corp	15 198	0,09	157	USD Palo Alto Networks Inc	46 296	0,26
52	USD IDEXX Laboratories Inc	28 863	0,16	126	USD Paramount Global	1 864	0,01
76	USD Illumina Inc	10 582	0,06	568	USD PayPal Holdings Inc	34 881	0,19

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Quantité	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Actions ordinaires et préférentielles – 100,06 % (suite)				Actions ordinaires et préférentielles – 100,06 % (suite)				
États-Unis (suite)				États-Unis (suite)				
2 815	USD Pfizer Inc	81 044	0,45	56	USD Waters Corp	18 437	0,10	
768	USD Philip Morris International Inc	72 253	0,40	129	USD Workday Inc	35 612	0,20	
436	USD Phillips 66	58 049	0,32	11	USD WW Grainger Inc	9 116	0,05	
112	USD PNC Financial Services Group Inc	17 343	0,10	1 031	USD Xylem Inc	117 905	0,66	
126	USD PPG Industries Inc	18 843	0,11	226	USD Yum! Brands Inc	29 529	0,16	
824	USD Principal Financial Group Inc	64 824	0,36	271	USD Zimmer Biomet Holdings Inc	32 981	0,18	
806	USD Procter & Gamble Co	118 111	0,66	32	USD Zoetis Inc	6 316	0,04	
275	USD Progressive Corp	43 802	0,24	États-Unis – Total			17 194 819	95,83
697	USD Prologis Inc REIT	92 910	0,52	Total des actions ordinaires et préférentielles			17 954 056	100,06
358	USD Prudential Financial Inc	37 128	0,21	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			17 954 056	100,06
16	USD PTC Inc	2 799	0,02	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			17 954 056	100,06
929	USD PulteGroup Inc	95 891	0,53	Autres actifs/(passifs) nets			(11 316)	(0,06)
363	USD Qualcomm Inc	52 501	0,29	TOTAL DES ACTIFS NETS			17 942 740	100,00
60	USD Regeneron Pharmaceuticals Inc	52 697	0,29					
486	USD Regions Financial Corp	9 419	0,05					
135	USD Reliance Steel & Aluminum Co	37 757	0,21					
77	USD Rockwell Automation Inc	23 907	0,13					
280	USD S&P Global Inc	123 346	0,69					
837	USD Salesforce Inc	220 248	1,23					
928	USD Schlumberger NV	48 293	0,27					
68	USD ServiceNow Inc	48 041	0,27					
130	USD Sherwin-Williams Co	40 547	0,23					
82	USD Simon Property Group Inc REIT	11 696	0,07					
680	USD Snap Inc	11 512	0,06					
85	USD Splunk Inc	12 950	0,07					
513	USD Starbucks Corp	49 253	0,27					
682	USD Steel Dynamics Inc	80 544	0,45					
213	USD Stryker Corp	63 785	0,36					
395	USD Sysco Corp	28 886	0,16					
20	USD Take-Two Interactive Software Inc	3 219	0,02					
333	USD Target Corp	47 426	0,26					
2 155	USD Tesla Inc	535 474	2,98					
26	USD Texas Pacific Land Corp	40 884	0,23					
182	USD Thermo Fisher Scientific Inc	96 604	0,54					
359	USD TJX Cos Inc	33 678	0,19					
201	USD T-Mobile US Inc	32 226	0,18					
89	USD TransDigm Group Inc	90 032	0,50					
122	USD Travelers Cos Inc	23 240	0,13					
125	USD Uber Technologies Inc	7 696	0,04					
379	USD UnitedHealth Group Inc	199 532	1,11					
463	USD US Bancorp	20 039	0,11					
88	USD Valero Energy Corp	11 440	0,06					
338	USD Ventas Inc REIT	16 846	0,09					
113	USD Verisk Analytics Inc	26 991	0,15					
3 198	USD Verizon Communications Inc	120 565	0,67					
107	USD Vertex Pharmaceuticals Inc	43 537	0,24					
2 232	USD Viatris Inc	24 173	0,14					
1 197	USD Visa Inc	311 639	1,74					
92	USD W R Berkley Corp	6 506	0,04					
669	USD Walgreens Boots Alliance Inc	17 468	0,10					
899	USD Walt Disney Co	81 171	0,45					
500	USD Warner Bros Discovery Inc	5 690	0,03					

Tableau des investissements au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>			
Obligations d'entreprise – 17,54 %				Obligations d'entreprise – 17,54 % <i>(suite)</i>			
Azerbaïdjan				Îles Vierges britanniques <i>(suite)</i>			
600 000 USD	Southern Gas Corridor CJSC, 6.875%, 24/03/26	608 437	0,26	200 000 USD	State Grid Overseas Investment BVI Ltd, 4.250%, 02/05/28	198 292	0,09
200 000 USD	State Oil Co of the Azerbaijan Republic, 6.950%, 18/03/30	210 063	0,09	300 000 USD	Sunny Express Enterprises Corp, 2.950%, 01/03/27	284 499	0,12
Azerbaïdjan – Total				Îles Vierges britanniques – Total			
818 500				4 382 709			
Bahreïn				Canada			
600 000 USD	Oil and Gas Holding Co BSCC, 7.500%, 25/10/27	631 500	0,27	200 000 USD	Petronas Energy Canada Ltd, 2.112%, 23/03/28	181 182	0,08
200 000 USD	Oil and Gas Holding Co BSCC, 8.375%, 07/11/28	218 875	0,10	Canada – Total			
Bahreïn – Total				181 182			
850 375				0,08			
Îles Vierges britanniques				Îles Caïmans			
200 000 USD	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd, 4.000%, perpetual	198 313	0,09	250 000 USD	Avi Funding Co Ltd, 3.800%, 16/09/25	244 788	0,11
300 000 USD	China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd, 3.080%, perpetual	285 844	0,12	400 000 USD	DP World Crescent Ltd, 3.875%, 18/07/29	378 448	0,16
200 000 USD	CNPC Global Capital Ltd, 2.000%, 23/06/30	172 080	0,07	200 000 USD	DP World Crescent Ltd, 5.500%, 13/09/33	204 516	0,09
200 000 USD	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 4.750%, 30/07/25	198 658	0,09	300 000 USD	EDO Sukuk Ltd, 5.875%, 21/09/33	308 812	0,13
300 000 USD	Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd, 3.080%, perpetual	284 250	0,12	400 000 USD	Gaci First Investment Co, 4.750%, 14/02/30	399 375	0,17
200 000 USD	Rongshi International Finance Ltd, 3.625%, 04/05/27	194 036	0,08	500 000 USD	Gaci First Investment Co, 4.875%, 14/02/35	487 500	0,21
300 000 USD	Sinochem Offshore Capital Co Ltd, 2.375%, 23/09/31	244 449	0,10	200 000 USD	Gaci First Investment Co, 5.375%, 13/10/22	178 313	0,08
500 000 USD	Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd, 4.875%, 17/05/42	492 075	0,21	300 000 USD	Mumtalakat Sukuk Holding Co, 4.100%, 21/01/27	281 906	0,12
300 000 USD	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4.375%, 10/04/24	299 156	0,13	200 000 USD	Nogaholding Sukuk Ltd, 6.625%, 25/05/33	209 000	0,09
200 000 USD	Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd, 3.250%, 13/09/27	191 736	0,08	850 000 USD	Sharjah Sukuk Program Ltd, 3.854%, 03/04/26	822 906	0,35
300 000 USD	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.500%, 08/08/24	295 031	0,13	200 000 USD	Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd, 3.150%, 02/06/26	192 882	0,08
250 000 USD	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.700%, 13/05/30	227 140	0,10	200 000 USD	Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd, 2.150%, 22/09/30	172 460	0,08
200 000 USD	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.300%, 08/01/31	175 210	0,08	200 000 USD	Unity 1 Sukuk Ltd, 2.394%, 03/11/25	189 356	0,08
200 000 USD	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 3.680%, 08/08/49	162 420	0,07	Îles Caïmans – Total			
200 000 USD	State Grid Overseas Investment 2013 Ltd, 4.375%, 22/05/43	189 162	0,08	4 070 262			
300 000 USD	State Grid Overseas Investment BVI Ltd, 3.500%, 04/05/27	290 358	0,12	Chili			
				200 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3.625%, 01/08/27	189 375	0,08
				200 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3.000%, 30/09/29	177 875	0,08
				200 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3.750%, 15/01/31	180 813	0,08
				400 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 5.125%, 02/02/33	386 120	0,17
				200 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 5.950%, 08/01/34	202 300	0,09
				200 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 5.625%, 18/10/43	192 687	0,08
				500 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 4.875%, 04/11/44	432 500	0,18
				650 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 6.300%, 08/09/53	656 584	0,28
				200 000 USD	Empresa de los Ferrocarriles del Estado, 3.830%, 14/09/61	135 962	0,06

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'entreprise – 17,54 % (suite)				Obligations d'entreprise – 17,54 % (suite)			
Chili (suite)				Indonésie (suite)			
200 000 USD	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 5.000%, 25/01/47	172 726	0,07	200 000 USD	Pertamina Persero PT, 6.500%, 07/11/48	221 812	0,09
200 000 USD	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 4.700%, 07/05/50	165 026	0,07	200 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.700%, 06/06/32	200 313	0,09
200 000 USD	Empresa Nacional del Petroleo, 3.450%, 16/09/31	167 674	0,07	1 150 000 USD	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 3.000%, 30/06/30	1 021 703	0,44
200 000 USD	Empresa Nacional del Petroleo, 6.150%, 10/05/33	200 122	0,09	200 000 USD	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 5.250%, 24/10/42	188 875	0,08
Chili – Total		3 259 764	1,40	Indonésie – Total		3 361 797	1,44
Chine				Kazakhstan			
400 000 USD	China Life Insurance Overseas Co Ltd, 5.350%, 15/08/33	404 244	0,17	400 000 USD	Development Bank of Kazakhstan JSC, 5.750%, 12/05/25	396 125	0,17
300 000 USD	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.500%, 12/11/24	293 063	0,13	300 000 USD	Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC, 2.000%, 28/10/26	276 375	0,12
Chine – Total		697 307	0,30	500 000 USD	QazaqGaz NC JSC, 4.375%, 26/09/27	478 906	0,20
Costa Rica				Kazakhstan – Total			
200 000 USD	Instituto Costarricense de Electricidad, 6.375%, 15/05/43	178 000	0,08			1 151 406	0,49
Costa Rica – Total		178 000	0,08	Malaisie			
Géorgie				600 000 USD	Khazanah Capital Ltd, 4.876%, 01/06/33	601 548	0,26
200 000 USD	Georgian Railway JSC, 4.000%, 17/06/28	183 188	0,08	200 000 USD	Khazanah Global Sukuk Bhd, 4.687%, 01/06/28	200 698	0,09
Géorgie – Total		183 188	0,08	200 000 USD	Malaysia Sovereign Sukuk Bhd, 3.043%, 22/04/25	195 746	0,08
Hong Kong				200 000 USD	Petronas Capital Ltd, 3.500%, 18/03/25	196 372	0,08
200 000 USD	Blossom Joy Ltd, 3.100%, perpetual	192 188	0,08	600 000 USD	Petronas Capital Ltd, 3.500%, 21/04/30	561 072	0,24
200 000 USD	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 3.375%, 19/06/24	197 948	0,09	1 850 000 USD	Petronas Capital Ltd, 2.480%, 28/01/32	1 578 919	0,68
200 000 USD	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 4.875%, 14/03/25	198 708	0,09	800 000 USD	Petronas Capital Ltd, 4.500%, 18/03/45	730 672	0,31
200 000 USD	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 4.125%, 19/07/27	193 132	0,08	800 000 USD	Petronas Capital Ltd, 4.550%, 21/04/50	735 808	0,32
200 000 USD	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 3.875%, 19/06/29	187 376	0,08	400 000 USD	Petronas Capital Ltd, 3.404%, 28/04/61	284 320	0,12
Hong-Kong – Total		969 352	0,42	Malaisie – Total		5 085 155	2,18
Hongrie				Mexique			
400 000 USD	MVM Energetika Zrt, 7.500%, 09/06/28	416 875	0,18	200 000 USD	Comision Federal de Electricidad, 4.750%, 23/02/27	194 858	0,08
Hongrie – Total		416 875	0,18	200 000 USD	Comision Federal de Electricidad, 4.688%, 15/05/29	188 063	0,08
Indonésie				250 000 USD	Comision Federal de Electricidad, 3.875%, 26/07/33	201 484	0,09
400 000 USD	Indonesia Asahan Aluminium PT / Mineral Industri Indonesia Persero PT, 5.450%, 15/05/30	401 875	0,17	200 000 USD	Comision Federal de Electricidad, 4.677%, 09/02/51	140 313	0,06
200 000 USD	Pelabuhan Indonesia Persero PT, 4.250%, 05/05/25	196 250	0,08	400 000 USD	Mexico City Airport Trust, 5.500%, 31/07/47	343 672	0,15
250 000 USD	Pertamina Persero PT, 3.100%, 27/08/30	224 219	0,10	150 000 USD	Petroleos Mexicanos, 4.250%, 15/01/25	145 406	0,06
300 000 USD	Pertamina Persero PT, 2.300%, 09/02/31	252 750	0,11	450 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.875%, 16/10/25	442 516	0,19
600 000 USD	Pertamina Persero PT, 6.450%, 30/05/44	654 000	0,28				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets		
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)					
Obligations d'entreprise – 17,54 % (suite)				Obligations d'entreprise – 17,54 % (suite)					
Mexique (suite)				Afrique du Sud					
450 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.500%, 13/03/27	418 219	0,18	200 000 USD	Eskom Holdings SOC Ltd, 7.125%, 11/02/25	199 813	0,08		
500 000 USD	Petroleos Mexicanos, 5.350%, 12/02/28	432 625	0,19	400 000 USD	Eskom Holdings SOC Ltd, 4.314%, 23/07/27	372 875	0,16		
100 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.500%, 23/01/29	88 063	0,04	500 000 USD	Eskom Holdings SOC Ltd, 8.450%, 10/08/28	505 312	0,22		
600 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.840%, 23/01/30	514 680	0,22	200 000 USD	Transnet SOC Ltd, 8.250%, 06/02/28	200 875	0,09		
450 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.700%, 16/02/32	372 375	0,16	Afrique du Sud – Total			1 278 875	0,55	
180 000 USD	Petroleos Mexicanos, 10.000%, 07/02/33	179 640	0,08	Trinité-et-Tobago					
550 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.625%, 15/06/35	418 344	0,18	200 000 USD	Heritage Petroleum Co Ltd, 9.000%, 12/08/29	209 375	0,09		
100 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.750%, 21/09/47	65 425	0,03	400 000 USD	Trinidad Generation UnLtd, 5.250%, 04/11/27	394 016	0,17		
350 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.350%, 12/02/48	222 001	0,09	Trinité-et-Tobago – Total			603 391	0,26	
1 250 000 USD	Petroleos Mexicanos, 7.690%, 23/01/50	889 062	0,38	Turquie					
500 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.950%, 28/01/60	328 750	0,14	200 000 USD	TC Ziraat Bankasi AS, 9.500%, 01/08/26	210 375	0,09		
70 000 USD	Petroleos Mexicanos, 6.625%, perpetual	42 175	0,02	Turquie – Total			210 375	0,09	
Mexique – Total			5 627 671	2,42	Émirats arabes unis				
Oman				300 000 USD	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 4.600%, 02/11/47	274 406	0,12		
700 000 USD	OQ SAOC, 5.125%, 06/05/28	691 250	0,30	400 000 USD	DP World Ltd/United Arab Emirates, 6.850%, 02/07/37	440 512	0,19		
Oman – Total			691 250	0,30	200 000 USD	MDGH GMTN RSC Ltd, 4.500%, 07/11/28	198 502	0,08	
Panama				200 000 USD	MDGH GMTN RSC Ltd, 3.375%, 28/03/32	182 716	0,08		
200 000 USD	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA, 4.000%, 11/08/41	150 640	0,07	800 000 USD	MDGH GMTN RSC Ltd, 5.500%, 28/04/33	846 576	0,36		
200 000 USD	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA, 5.125%, 11/08/61	150 014	0,07	400 000 USD	MDGH GMTN RSC Ltd, 5.875%, 01/05/34	436 148	0,19		
200 000 USD	Banco Nacional de Panama, 2.500%, 11/08/30	148 566	0,06	200 000 USD	MDGH GMTN RSC Ltd, 3.950%, 21/05/50	165 666	0,07		
200 000 USD	Empresa de Transmision Electrica SA, 5.125%, 02/05/49	146 022	0,06	Émirats arabes unis – Total			2 544 526	1,09	
Panama – Total			595 242	0,26	Royaume-Uni				
Pérou				250 000 USD	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC, 7.625%, 08/11/28	115 000	0,05		
400 000 USD	Petroleos del Peru SA, 4.750%, 19/06/32	282 852	0,12	200 000 USD	State Grid Europe Development 2014 PLC, 3.125%, 07/04/25	195 526	0,08		
400 000 USD	Petroleos del Peru SA, 5.625%, 19/06/47	245 916	0,11	Royaume-Uni – Total			310 526	0,13	
Pérou – Total			528 768	0,23	États-Unis				
Philippines				200 000 USD	Dae Funding LLC, 1.550%, 01/08/24	194 375	0,08		
200 000 USD	Power Sector Assets & Liabilities Management Corp, 7.390%, 02/12/24	203 172	0,09	États-Unis – Total			194 375	0,08	
Philippines – Total			203 172	0,09	Îles vierges des États-Unis				
Qatar				200 000 USD	Chinalco Capital Holdings Ltd, 2.950%, perpetual	188 498	0,08		
200 000 USD	QatarEnergy, 1.375%, 12/09/26	183 328	0,08	Îles vierges des États-Unis – Total			188 498	0,08	
1 350 000 USD	QatarEnergy, 2.250%, 12/07/31	1 147 432	0,49	Total des obligations d'entreprise				40 809 071	17,54
550 000 USD	QatarEnergy, 3.125%, 12/07/41	422 180	0,18						
650 000 USD	QatarEnergy, 3.300%, 12/07/51	473 590	0,21						
Qatar – Total			2 226 530	0,96					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 80,49 %				Obligations d'État – 80,49 % (suite)			
Angola				Bolivie			
200 000 USD	Angolan Government International Bond, 9.500%, 12/11/25	196 750	0,08	800 000 USD	Bolivian Government International Bond, 4.500%, 20/03/28	378 400	0,16
200 000 USD	Angolan Government International Bond, 8.250%, 09/05/28	184 000	0,08	Bolivie – Total			
2 500 000 USD	Angolan Government International Bond, 8.750%, 14/04/32	2 203 125	0,95	Brésil			
230 000 USD	Angolan Government International Bond, 9.375%, 08/05/48	191 475	0,08	600 000 USD	Brazilian Government International Bond, 4.250%, 07/01/25	591 938	0,25
200 000 USD	Angolan Government International Bond, 9.125%, 26/11/49	163 250	0,07	400 000 USD	Brazilian Government International Bond, 2.875%, 06/06/25	385 750	0,17
Angola – Total			1,26	150 000 USD	Brazilian Government International Bond, 10.125%, 15/05/27	171 990	0,07
Argentine				900 000 USD	Brazilian Government International Bond, 4.625%, 13/01/28	889 533	0,38
2 200 000 USD	Argentine Republic Government International Bond, 1.000%, 09/07/29	871 376	0,37	1 600 000 USD	Brazilian Government International Bond, 3.875%, 12/06/30	1 462 000	0,63
2 300 000 USD	Argentine Republic Government International Bond, 0.750%, 09/07/30	918 390	0,40	235 000 USD	Brazilian Government International Bond, 6.250%, 18/03/31	243 690	0,11
3 350 000 USD	Argentine Republic Government International Bond, 3.625%, 09/07/35	1 133 908	0,49	1 000 000 USD	Brazilian Government International Bond, 6.000%, 20/10/33	998 350	0,43
600 000 USD	Argentine Republic Government International Bond, 4.250%, 09/01/38	236 772	0,10	300 000 USD	Brazilian Government International Bond, 8.250%, 20/01/34	352 227	0,15
1 150 000 USD	Argentine Republic Government International Bond, 3.500%, 09/07/41	389 562	0,17	1 450 000 USD	Brazilian Government International Bond, 7.125%, 20/01/37	1 581 718	0,68
Argentine – Total			1,53	470 000 USD	Brazilian Government International Bond, 5.625%, 07/01/41	432 870	0,19
Azerbaïdjan				650 000 USD	Brazilian Government International Bond, 4.750%, 14/01/50	498 875	0,21
450 000 USD	Republic of Azerbaijan International Bond, 3.500%, 01/09/32	389 531	0,17	Brésil – Total			
Azerbaïdjan – Total			0,17	7 608 941			
Bahreïn				3,27			
1 060 000 USD	Bahrain Government International Bond, 4.250%, 25/01/28	997 725	0,43	Îles Caïmans			
450 000 USD	Bahrain Government International Bond, 7.000%, 12/10/28	468 000	0,20	200 000 USD	KSA Sukuk Ltd, 5.268%, 25/10/28	207 500	0,09
1 150 000 USD	Bahrain Government International Bond, 6.750%, 20/09/29	1 166 531	0,50	200 000 USD	Maldives Sukuk Issuance Ltd, 9.875%, 08/04/26	160 188	0,07
950 000 USD	Bahrain Government International Bond, 7.375%, 14/05/30	988 891	0,43	200 000 USD	Sharjah Sukuk Program Ltd, 3.200%, 13/07/31	172 250	0,07
350 000 USD	Bahrain Government International Bond, 5.625%, 30/09/31	328 344	0,14	Îles Caïmans – Total			
1 000 000 USD	Bahrain Government International Bond, 5.250%, 25/01/33	888 437	0,38	539 938			
600 000 USD	Bahrain Government International Bond, 6.000%, 19/09/44	492 780	0,21	Chili			
200 000 USD	CBB International Sukuk Co 6 Spc, 5.250%, 20/03/25	197 125	0,08	1 150 000 USD	Chile Government International Bond, 2.750%, 31/01/27	1 083 516	0,47
Bahreïn – Total			2,37	320 000 USD	Chile Government International Bond, 3.240%, 06/02/28	304 200	0,13
Barbade				300 000 USD	Chile Government International Bond, 2.550%, 27/01/32	257 340	0,11
100 000 USD	Barbados Government International Bond, 6.500%, 01/10/29	93 957	0,04	200 000 USD	Chile Government International Bond, 3.500%, 31/01/34	178 062	0,08
Barbade – Total			0,04	200 000 USD	Chile Government International Bond, 4.950%, 05/01/36	197 437	0,08

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)			
Chili (suite)				Colombie (suite)			
400 000 USD	Chile Government International Bond, 3.100%, 07/05/41	303 000	0,13	1 000 000 USD	Colombia Government International Bond, 5.625%, 26/02/44	838 125	0,36
400 000 USD	Chile Government International Bond, 4.340%, 07/03/42	356 375	0,15	810 000 USD	Colombia Government International Bond, 5.000%, 15/06/45	625 219	0,27
550 000 USD	Chile Government International Bond, 3.500%, 25/01/50	417 141	0,18	700 000 USD	Colombia Government International Bond, 5.200%, 15/05/49	546 000	0,24
699 460 USD	Chile Government International Bond, 5.330%, 05/01/54	695 307	0,30	400 000 USD	Colombia Government International Bond, 8.750%, 14/11/53	459 375	0,20
400 000 USD	Chile Government International Bond, 3.250%, 21/09/71	267 375	0,11				
Chili – Total		4 059 753	1,74	Colombie – Total		6 834 469	2,94
Chine				Costa Rica			
200 000 USD	China Development Bank, 1.000%, 27/10/25	186 936	0,08	650 000 USD	Costa Rica Government International Bond, 6.125%, 19/02/31	664 422	0,28
400 000 USD	China Development Bank, 1.625%, 27/10/30	338 392	0,14	600 000 USD	Costa Rica Government International Bond, 6.550%, 03/04/34	621 300	0,27
1 050 000 USD	China Government International Bond, 0.550%, 21/10/25	977 991	0,42	650 000 USD	Costa Rica Government International Bond, 7.158%, 12/03/45	687 940	0,30
300 000 USD	China Government International Bond, 1.250%, 26/10/26	276 090	0,12	600 000 USD	Costa Rica Government International Bond, 7.300%, 13/11/54	650 340	0,28
200 000 USD	China Government International Bond, 2.625%, 02/11/27	191 038	0,08	Costa Rica – Total		2 624 002	1,13
450 000 USD	China Government International Bond, 2.750%, 03/12/39	366 669	0,16	République dominicaine			
200 000 USD	Export-Import Bank of China, 3.625%, 31/07/24	198 125	0,08	200 000 USD	Dominican Republic International Bond, 6.875%, 29/01/26	203 340	0,09
300 000 USD	Export-Import Bank of China, 3.375%, 14/03/27	291 912	0,13	200 000 USD	Dominican Republic International Bond, 5.950%, 25/01/27	200 416	0,09
Chine – Total		2 827 153	1,21	340 000 USD	Dominican Republic International Bond, 6.000%, 19/07/28	340 000	0,14
Colombie				650 000 USD	Dominican Republic International Bond, 4.500%, 30/01/30	597 187	0,26
200 000 USD	Colombia Government International Bond, 4.500%, 28/01/26	196 000	0,08	550 000 USD	Dominican Republic International Bond, 7.050%, 03/02/31	576 923	0,25
200 000 USD	Colombia Government International Bond, 3.875%, 25/04/27	190 563	0,08	950 000 USD	Dominican Republic International Bond, 4.875%, 23/09/32	863 683	0,37
400 000 USD	Colombia Government International Bond, 4.500%, 15/03/29	373 375	0,16	2 400 000 USD	Dominican Republic International Bond, 6.000%, 22/02/33	2 358 048	1,01
600 000 USD	Colombia Government International Bond, 3.000%, 30/01/30	504 562	0,22	250 000 USD	Dominican Republic International Bond, 7.450%, 30/04/44	264 625	0,11
900 000 USD	Colombia Government International Bond, 3.125%, 15/04/31	731 531	0,31	440 000 USD	Dominican Republic International Bond, 6.850%, 27/01/45	437 580	0,19
200 000 USD	Colombia Government International Bond, 8.000%, 20/04/33	218 312	0,09	150 000 USD	Dominican Republic International Bond, 6.500%, 15/02/48	142 800	0,06
1 200 000 USD	Colombia Government International Bond, 7.500%, 02/02/34	1 264 125	0,54	300 000 USD	Dominican Republic International Bond, 6.400%, 05/06/49	282 000	0,12
550 000 USD	Colombia Government International Bond, 7.375%, 18/09/37	569 766	0,25	700 000 USD	Dominican Republic International Bond, 5.875%, 30/01/60	604 800	0,26
350 000 USD	Colombia Government International Bond, 6.125%, 18/01/41	317 516	0,14	République dominicaine – Total		6 871 402	2,95

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)			
Équateur				Salvador (suite)			
2 450 000 USD	Ecuador Government International Bond, zero coupon, 31/07/30	694 575	0,30	1 000 000 USD	El Salvador Government International Bond, 7.125%, 20/01/50	705 938	0,30
1 000 000 USD	Ecuador Government International Bond, 6.000%, 31/07/30	463 000	0,20	150 000 USD	El Salvador Government International Bond, 9.500%, 15/07/52	124 453	0,05
2 050 000 USD	Ecuador Government International Bond, 3.500%, 31/07/35	726 725	0,31				
200 000 USD	Ecuador Government International Bond, 2.500%, 31/07/40	63 000	0,03	Salvador – Total		1 647 141	0,71
Équateur – Total		1 947 300	0,84	Éthiopie			
Égypte				400 000 USD Ethiopia International Bond, 6.625%, 11/12/24			
750 000 USD	Egypt Government International Bond, 7.500%, 31/01/27	630 000	0,27	Éthiopie – Total		266 000	0,11
1 600 000 USD	Egypt Government International Bond, 5.800%, 30/09/27	1 229 500	0,53	Gabon			
200 000 USD	Egypt Government International Bond, 6.588%, 21/02/28	152 937	0,07	200 000 USD	Gabon Government International Bond, 6.950%, 16/06/25	189 812	0,08
700 000 USD	Egypt Government International Bond, 7.600%, 01/03/29	532 437	0,23	600 000 USD	Gabon Government International Bond, 7.000%, 24/11/31	497 625	0,21
550 000 USD	Egypt Government International Bond, 5.875%, 16/02/31	358 875	0,15	Gabon – Total		687 437	0,29
900 000 USD	Egypt Government International Bond, 7.625%, 29/05/32	622 969	0,27	Allemagne			
1 150 000 USD	Egypt Government International Bond, 6.875%, 30/04/40	690 359	0,30	200 000 USD	Georgia Government International Bond, 2.750%, 22/04/26	187 000	0,08
450 000 USD	Egypt Government International Bond, 8.500%, 31/01/47	279 281	0,12	Allemagne – Total		187 000	0,08
200 000 USD	Egypt Government International Bond, 7.903%, 21/02/48	120 063	0,05	Ghana			
200 000 USD	Egypt Government International Bond, 8.700%, 01/03/49	124 688	0,05	900 000 USD	Ghana Government International Bond, 0.010%, 07/04/25	340 031	0,14
200 000 USD	Egypt Government International Bond, 8.875%, 29/05/50	126 938	0,05	400 000 USD	Ghana Government International Bond, 8.125%, 18/01/26	182 625	0,08
200 000 USD	Egypt Government International Bond, 7.500%, 16/02/61	116 313	0,05	800 000 USD	Ghana Government International Bond, 7.875%, 26/03/27	354 750	0,15
300 000 USD	Egyptian Financial Co for Sovereign Taskeek, 10.875%, 28/02/26	293 156	0,13	400 000 USD	Ghana Government International Bond, 7.625%, 16/05/29	172 000	0,07
Égypte – Total		5 277 516	2,27	200 000 USD	Ghana Government International Bond, 10.750%, 14/10/30	125 500	0,05
Salvador				800 000 USD	Ghana Government International Bond, 8.125%, 26/03/32	348 000	0,15
400 000 USD	El Salvador Government International Bond, 6.375%, 18/01/27	351 250	0,15	200 000 USD	Ghana Government International Bond, 8.625%, 07/04/34	86 000	0,04
250 000 USD	El Salvador Government International Bond, 8.625%, 28/02/29	222 734	0,10	650 000 USD	Ghana Government International Bond, 8.625%, 07/04/34	279 500	0,12
150 000 USD	El Salvador Government International Bond, 8.250%, 10/04/32	126 375	0,06	200 000 USD	Ghana Government International Bond, 8.627%, 16/06/49	84 500	0,04
150 000 USD	El Salvador Government International Bond, 7.650%, 15/06/35	116 391	0,05	200 000 USD	Ghana Government International Bond, 8.950%, 26/03/51	85 875	0,04
				Ghana – Total		2 058 781	0,88
				Guatemala			
				200 000 USD	Guatemala Government Bond, 4.875%, 13/02/28	194 800	0,08
				1 150 000 USD	Guatemala Government Bond, 5.375%, 24/04/32	1 113 775	0,48
				400 000 USD	Guatemala Government Bond, 3.700%, 07/10/33	332 800	0,14
				600 000 USD	Guatemala Government Bond, 6.600%, 13/06/36	616 500	0,27
				200 000 USD	Guatemala Government Bond, 6.125%, 01/06/50	189 200	0,08
				Guatemala – Total		2 447 075	1,05

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)			
Honduras				Indonésie (suite)			
300 000 USD	Honduras Government International Bond, 6.250%, 19/01/27	287 250	0,12	400 000 USD	Indonesia Government International Bond, 1.850%, 12/03/31	332 544	0,14
150 000 USD	Honduras Government International Bond, 5.625%, 24/06/30	133 500	0,06	200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.650%, 20/09/32	199 687	0,09
Honduras – Total		420 750	0,18	450 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.850%, 11/01/33	459 141	0,20
Hongrie				200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 7.750%, 17/01/38	256 312	0,11
400 000 USD	Hungary Government International Bond, 6.125%, 22/05/28	416 064	0,18	400 000 USD	Indonesia Government International Bond, 6.750%, 15/01/44	489 875	0,21
200 000 USD	Hungary Government International Bond, 5.250%, 16/06/29	201 106	0,09	650 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.200%, 15/10/50	583 172	0,25
800 000 USD	Hungary Government International Bond, 2.125%, 22/09/31	644 856	0,28	200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 3.050%, 12/03/51	152 313	0,07
900 000 USD	Hungary Government International Bond, 6.250%, 22/09/32	960 408	0,41	200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 5.450%, 20/09/52	212 562	0,09
600 000 USD	Hungary Government International Bond, 5.500%, 16/06/34	607 860	0,26	500 000 USD	Indonesia Government International Bond, 5.650%, 11/01/53	546 562	0,23
700 000 USD	Hungary Government International Bond, 7.625%, 29/03/41	836 955	0,36	550 000 USD	Indonesia Government International Bond, 3.200%, 23/09/61	397 203	0,17
700 000 USD	Hungary Government International Bond, 3.125%, 21/09/51	472 941	0,20	200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.450%, 15/04/70	179 688	0,08
200 000 USD	Hungary Government International Bond, 6.750%, 25/09/52	223 846	0,10	550 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 1.500%, perpetual	507 719	0,22
650 000 USD	Magyar Export-Import Bank Zrt, 6.125%, 04/12/27	661 277	0,28	200 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 2.300%, 23/06/25	192 200	0,08
500 000 USD	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt, 6.500%, 29/06/28	513 685	0,22	200 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.550%, 29/03/26	199 625	0,09
Hongrie – Total		5 538 998	2,38	500 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 5.400%, 15/11/28	515 000	0,22
Inde				400 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4.450%, 20/02/29	398 125	0,17
300 000 USD	Export-Import Bank of India, 3.375%, 05/08/26	287 613	0,12	200 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 2.800%, 23/06/30	180 125	0,08
650 000 USD	Export-Import Bank of India, 3.875%, 01/02/28	623 356	0,27	200 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 5.600%, 15/11/33	212 772	0,09
200 000 USD	Export-Import Bank of India, 3.250%, 15/01/30	181 384	0,08	200 000 USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 3.800%, 23/06/50	165 688	0,07
450 000 USD	Export-Import Bank of India, 5.500%, 18/01/33	463 523	0,20	Indonésie – Total		7 857 971	3,38
Inde – Total		1 555 876	0,67	Irak			
Indonésie				421 875 USD	Iraq International Bond, 5.800%, 15/01/28	393 662	0,17
600 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.750%, 08/01/26	599 437	0,26	140 625 USD	Iraq International Bond, 5.800%, 15/01/28	131 221	0,06
200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.350%, 08/01/27	198 563	0,08	Irak – Total		524 883	0,23
400 000 USD	Indonesia Government International Bond, 3.850%, 18/07/27	389 875	0,17				
300 000 USD	Indonesia Government International Bond, 4.750%, 11/02/29	302 283	0,13				
200 000 USD	Indonesia Government International Bond, 3.400%, 18/09/29	187 500	0,08				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)				
Côte-d'Ivoire				Liban				
400 000 USD	Ivory Coast Government International Bond, 6.375%, 03/03/28	392 125	0,17	400 000 USD	Lebanon Government International Bond, 6.000%, 27/01/23 *	23 375	0,01	
100 000 USD	Ivory Coast Government International Bond, 6.125%, 15/06/33	91 812	0,04	3 100 000 USD	Lebanon Government International Bond, 6.650%, 22/04/24	183 781	0,08	
200 000 USD	Ivory Coast Government International Bond, 6.125%, 15/06/33	183 625	0,08	550 000 USD	Lebanon Government International Bond, 6.200%, 26/02/25	32 484	0,02	
Côte-d'Ivoire – Total			0,29	50 000 USD	Lebanon Government International Bond, 6.200%, 26/02/25	2 953	0,00	
Jamaïque				200 000 USD	Lebanon Government International Bond, 6.750%, 29/11/27	11 938	0,01	
400 000 USD	Jamaica Government International Bond, 6.750%, 28/04/28	424 428	0,18	150 000 USD	Lebanon Government International Bond, 6.750%, 29/11/27	8 953	0,00	
400 000 USD	Jamaica Government International Bond, 8.000%, 15/03/39	498 000	0,21	75 000 USD	Lebanon Government International Bond, 7.000%, 23/03/32	4 477	0,00	
600 000 USD	Jamaica Government International Bond, 7.875%, 28/07/45	732 900	0,32	400 000 USD	Lebanon Government International Bond, 7.050%, 02/11/35	23 875	0,01	
Jamaïque – Total			0,71	150 000 USD	Lebanon Government International Bond, 7.250%, 23/03/37	8 906	0,00	
Jordanie				Liban – Total				
200 000 USD	Jordan Government International Bond, 4.950%, 07/07/25	195 375	0,08				300 742	0,13
200 000 USD	Jordan Government International Bond, 6.125%, 29/01/26	199 063	0,09	Malaisie				
950 000 USD	Jordan Government International Bond, 7.500%, 13/01/29	960 687	0,41	250 000 USD	Malaysia Sovereign Sukuk Bhd, 4.236%, 22/04/45	235 525	0,10	
900 000 USD	Jordan Government International Bond, 5.850%, 07/07/30	834 469	0,36	750 000 USD	Malaysia Wakala Sukuk Bhd, 2.070%, 28/04/31	645 862	0,28	
100 000 USD	Jordan Government International Bond, 7.375%, 10/10/47	88 600	0,04	Malaisie – Total			881 387	0,38
Jordanie – Total			0,98	Mexique				
Kazakhstan				400 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.125%, 21/01/26	396 250	0,17	
800 000 USD	Kazakhstan Government International Bond, 5.125%, 21/07/25	809 000	0,35	660 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.750%, 11/01/28	635 869	0,27	
900 000 USD	Kazakhstan Government International Bond, 4.875%, 14/10/44	866 531	0,37	200 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.500%, 22/04/29	196 750	0,08	
Kazakhstan – Total			0,72	200 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.250%, 16/04/30	180 750	0,08	
Kenya				900 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.750%, 27/04/32	865 125	0,37	
800 000 USD	Republic of Kenya Government International Bond, 7.250%, 28/02/28	732 000	0,31	217 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.500%, 12/02/34	183 568	0,08	
400 000 USD	Republic of Kenya Government International Bond, 8.000%, 22/05/32	361 000	0,16	100 000 USD	Mexico Government International Bond, 6.750%, 27/09/34	107 875	0,05	
500 000 USD	Republic of Kenya Government International Bond, 8.250%, 28/02/48	413 750	0,18	200 000 USD	Mexico Government International Bond, 6.350%, 09/02/35	209 187	0,09	
Kenya – Total			0,65	450 000 USD	Mexico Government International Bond, 6.050%, 11/01/40	453 797	0,19	
Koweït				630 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.280%, 14/08/41	519 750	0,22	
1 300 000 USD	Kuwait International Government Bond, 3.500%, 20/03/27	1 269 645	0,55	150 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.750%, 08/03/44	128 578	0,06	
Koweït – Total			0,55					

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)			
Mexique (suite)				Nigeria			
250 000 USD	Mexico Government International Bond, 5.550%, 21/01/45	238 047	0,10	200 000 USD	Nigeria Government International Bond, 6.500%, 28/11/27	182 375	0,08
200 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.600%, 10/02/48	164 875	0,07	800 000 USD	Nigeria Government International Bond, 8.375%, 24/03/29	766 250	0,33
1 310 000 USD	Mexico Government International Bond, 6.338%, 04/05/53	1 333 744	0,57	750 000 USD	Nigeria Government International Bond, 7.143%, 23/02/30	674 297	0,29
300 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.750%, 19/04/71	199 500	0,09	1 050 000 USD	Nigeria Government International Bond, 8.747%, 21/01/31	999 141	0,43
200 000 USD	Mexico Government International Bond, 5.750%, perpetual	178 438	0,08	500 000 USD	Nigeria Government International Bond, 7.875%, 16/02/32	448 281	0,19
Mexique – Total		5 992 103	2,57	1 240 000 USD	Nigeria Government International Bond, 7.375%, 28/09/33	1 055 162	0,45
Mongolie				870 000 USD	Nigeria Government International Bond, 7.696%, 23/02/38	712 313	0,31
200 000 USD	Mongolia Government International Bond, 5.125%, 07/04/26	194 187	0,09	Nigeria – Total		4 837 819	2,08
210 000 USD	Mongolia Government International Bond, 3.500%, 07/07/27	187 556	0,08	Oman			
200 000 USD	Mongolia Government International Bond, 8.650%, 19/01/28	210 500	0,09	200 000 USD	Oman Government International Bond, 4.875%, 01/02/25	198 188	0,08
200 000 USD	Mongolia Government International Bond, 4.450%, 07/07/31	167 813	0,07	200 000 USD	Oman Government International Bond, 5.375%, 08/03/27	201 125	0,09
Mongolie – Total		760 056	0,33	1 250 000 USD	Oman Government International Bond, 6.750%, 28/10/27	1 307 203	0,56
Maroc				500 000 USD	Oman Government International Bond, 5.625%, 17/01/28	508 750	0,22
400 000 USD	Morocco Government International Bond, 2.375%, 15/12/27	357 750	0,15	350 000 USD	Oman Government International Bond, 6.000%, 01/08/29	362 250	0,16
1 000 000 USD	Morocco Government International Bond, 3.000%, 15/12/32	821 562	0,35	2 000 000 USD	Oman Government International Bond, 6.250%, 25/01/31	2 100 625	0,90
450 000 USD	Morocco Government International Bond, 6.500%, 08/09/33	474 328	0,21	650 000 USD	Oman Government International Bond, 7.375%, 28/10/32	736 734	0,32
200 000 USD	Morocco Government International Bond, 5.500%, 11/12/42	181 375	0,08	200 000 USD	Oman Government International Bond, 7.000%, 25/01/51	215 375	0,09
200 000 USD	Morocco Government International Bond, 4.000%, 15/12/50	143 563	0,06	650 000 USD	Oman Sovereign Sukuk Co, 5.932%, 31/10/25	656 297	0,28
Maroc – Total		1 978 578	0,85	Oman – Total		6 286 547	2,70
Mozambique				Pakistan			
400 000 USD	Mozambique International Bond, 9.000%, 15/09/31	338 875	0,15	270 000 USD	Pakistan Global Sukuk Programme Co Ltd, 7.950%, 31/01/29	197 438	0,09
Mozambique – Total		338 875	0,15	600 000 USD	Pakistan Government International Bond, 6.000%, 08/04/26	422 062	0,18
Namibie				800 000 USD	Pakistan Government International Bond, 6.875%, 05/12/27	542 500	0,23
100 000 USD	Namibia International Bonds, 5.250%, 29/10/25	98 563	0,04	700 000 USD	Pakistan Government International Bond, 7.375%, 08/04/31	424 156	0,18
200 000 USD	Namibia International Bonds, 5.250%, 29/10/25	197 125	0,09	200 000 USD	Pakistan Water & Power Development Authority, 7.500%, 04/06/31	104 000	0,05
Namibie – Total		295 688	0,13	Pakistan – Total		1 690 156	0,73

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)			
Panama				Paraguay (suite)			
200 000 USD	Panama Government International Bond, 3.750%, 16/03/25	194 125	0,08	200 000 USD	Paraguay Government International Bond, 5.600%, 13/03/48	182 800	0,08
350 000 USD	Panama Government International Bond, 7.125%, 29/01/26	357 000	0,15	200 000 USD	Paraguay Government International Bond, 5.400%, 30/03/50	178 300	0,07
400 000 USD	Panama Government International Bond, 3.875%, 17/03/28	368 750	0,16				
500 000 USD	Panama Government International Bond, 3.160%, 23/01/30	425 469	0,18	Paraguay – Total		1 959 782	0,84
1 300 000 USD	Panama Government International Bond, 2.252%, 29/09/32	948 594	0,41	Pérou			
600 000 USD	Panama Government International Bond, 3.298%, 19/01/33	474 375	0,20	250 000 USD	Peruvian Government International Bond, 7.350%, 21/07/25	257 812	0,11
350 000 USD	Panama Government International Bond, 6.400%, 14/02/35	341 250	0,15	400 000 USD	Peruvian Government International Bond, 2.392%, 23/01/26	379 750	0,16
200 000 USD	Panama Government International Bond, 6.700%, 26/01/36	198 125	0,09	100 000 USD	Peruvian Government International Bond, 4.125%, 25/08/27	97 844	0,04
200 000 USD	Panama Government International Bond, 4.500%, 15/05/47	141 687	0,06	970 000 USD	Peruvian Government International Bond, 2.844%, 20/06/30	860 269	0,37
400 000 USD	Panama Government International Bond, 4.500%, 16/04/50	277 000	0,12	300 000 USD	Peruvian Government International Bond, 2.783%, 23/01/31	260 719	0,11
450 000 USD	Panama Government International Bond, 4.300%, 29/04/53	300 516	0,13	100 000 USD	Peruvian Government International Bond, 1.862%, 01/12/32	78 125	0,04
920 000 USD	Panama Government International Bond, 6.853%, 28/03/54	859 050	0,37	1 050 000 USD	Peruvian Government International Bond, 3.000%, 15/01/34	883 969	0,38
400 000 USD	Panama Government International Bond, 4.500%, 01/04/56	268 250	0,12	750 000 USD	Peruvian Government International Bond, 6.550%, 14/03/37	833 437	0,36
250 000 USD	Panama Government International Bond, 3.870%, 23/07/60	149 297	0,06	1 000 000 USD	Peruvian Government International Bond, 3.300%, 11/03/41	775 625	0,33
400 000 USD	Panama Government International Bond, 4.500%, 19/01/63	261 375	0,11	275 000 USD	Peruvian Government International Bond, 3.550%, 10/03/51	208 055	0,09
Panama – Total		5 564 863	2,39	550 000 USD	Peruvian Government International Bond, 2.780%, 01/12/60	342 203	0,15
Papouasie-Nouvelle-Guinée				700 000 USD	Peruvian Government International Bond, 3.600%, 15/01/72	492 800	0,21
200 000 USD	Papua New Guinea Government International Bond, 8.375%, 04/10/28	185 688	0,08	400 000 USD	Peruvian Government International Bond, 3.230%, 28/07/21	248 625	0,11
Papouasie-Nouvelle-Guinée – Total		185 688	0,08	Pérou – Total		5 719 233	2,46
Paraguay				Philippines			
50 000 USD	Paraguay Government International Bond, 5.000%, 15/04/26	49 442	0,02	100 000 USD	Philippine Government International Bond, 10.625%, 16/03/25	106 386	0,05
450 000 USD	Paraguay Government International Bond, 2.739%, 29/01/33	369 000	0,16	400 000 USD	Philippine Government International Bond, 5.500%, 30/03/26	406 000	0,17
660 000 USD	Paraguay Government International Bond, 3.849%, 28/06/33	583 440	0,25	1 100 000 USD	Philippine Government International Bond, 4.625%, 17/07/28	1 102 062	0,47
200 000 USD	Paraguay Government International Bond, 5.850%, 21/08/33	203 600	0,09				
400 000 USD	Paraguay Government International Bond, 6.100%, 11/08/44	393 200	0,17				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)				
Philippines (suite)				Pologne (suite)				
200 000 USD	Philippine Government International Bond, 3.750%, 14/01/29	192 375	0,08	1 550 000 USD	Republic of Poland Government International Bond, 4.875%, 04/10/33	1 566 663	0,67	
400 000 USD	Philippine Government International Bond, 7.750%, 14/01/31	474 000	0,20	400 000 USD	Republic of Poland Government International Bond, 5.500%, 04/04/53	416 164	0,18	
450 000 USD	Philippine Government International Bond, 1.950%, 06/01/32	370 828	0,16	Pologne – Total			4 480 853	1,92
950 000 USD	Philippine Government International Bond, 3.556%, 29/09/32	876 375	0,38	Qatar				
800 000 USD	Philippine Government International Bond, 5.000%, 17/07/33	821 000	0,35	200 000 USD	Qatar Government International Bond, 3.400%, 16/04/25	195 976	0,09	
400 000 USD	Philippine Government International Bond, 5.000%, 13/01/37	408 375	0,17	800 000 USD	Qatar Government International Bond, 3.250%, 02/06/26	776 000	0,33	
200 000 USD	Philippine Government International Bond, 3.950%, 20/01/40	180 375	0,08	800 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.000%, 14/03/29	792 936	0,34	
500 000 USD	Philippine Government International Bond, 3.700%, 01/03/41	428 437	0,18	160 000 USD	Qatar Government International Bond, 9.750%, 15/06/30	208 853	0,09	
200 000 USD	Philippine Government International Bond, 3.200%, 06/07/46	153 563	0,07	1 050 000 USD	Qatar Government International Bond, 6.400%, 20/01/40	1 217 401	0,52	
200 000 USD	Philippine Government International Bond, 4.200%, 29/03/47	177 250	0,08	400 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.625%, 02/06/46	381 532	0,16	
200 000 USD	Philippine Government International Bond, 5.950%, 13/10/47	222 313	0,10	1 150 000 USD	Qatar Government International Bond, 5.103%, 23/04/48	1 162 305	0,50	
1 000 000 USD	Philippine Government International Bond, 5.500%, 17/01/48	1 050 625	0,45	400 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.817%, 14/03/49	388 636	0,17	
200 000 USD	ROP Sukuk Trust, 5.045%, 06/06/29	203 250	0,09	650 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.400%, 16/04/50	599 671	0,26	
Philippines – Total			3,08	Qatar – Total			2,46	
Pologne				Roumanie				
400 000 USD	Bank Gospodarstwa Krajowego, 6.250%, 31/10/28	421 920	0,18	250 000 USD	Romanian Government International Bond, 5.250%, 25/11/27	247 728	0,11	
1 150 000 USD	Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.375%, 22/05/33	1 164 548	0,50	700 000 USD	Romanian Government International Bond, 6.625%, 17/02/28	722 771	0,31	
300 000 USD	Republic of Poland Government International Bond, 3.250%, 06/04/26	290 355	0,12	100 000 USD	Romanian Government International Bond, 3.625%, 27/03/32	86 328	0,04	
370 000 USD	Republic of Poland Government International Bond, 5.500%, 16/11/27	383 786	0,17	1 650 000 USD	Romanian Government International Bond, 7.125%, 17/01/33	1 780 185	0,76	
220 000 USD	Republic of Poland Government International Bond, 5.750%, 16/11/32	237 417	0,10	400 000 USD	Romanian Government International Bond, 6.125%, 22/01/44	393 440	0,17	
				200 000 USD	Romanian Government International Bond, 5.125%, 15/06/48	171 080	0,07	
				350 000 USD	Romanian Government International Bond, 4.000%, 14/02/51	252 154	0,11	
				600 000 USD	Romanian Government International Bond, 7.625%, 17/01/53	670 392	0,29	
				360 000 USD	Romanian Government International Bond, 3.000%, perpetual	306 061	0,13	
				Roumanie – Total			4 630 139	1,99

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)			
Rwanda				Afrique du Sud			
200 000 USD	Rwanda International Government Bond, 5.500%, 09/08/31	159 563	0,07	400 000 USD	Republic of South Africa Government International Bond, 5.875%, 16/09/25	403 250	0,17
Rwanda – Total				Afrique du Sud – Total			
159 563 0,07				5 413 089 2,33			
Arabie saoudite				Sri Lanka			
400 000 USD	KSA Sukuk Ltd, 4.274%, 22/05/29	397 000	0,17	200 000 USD	Sri Lanka Government International Bond, 5.750%, 18/04/23 *	102 180	0,04
400 000 USD	KSA Sukuk Ltd, 4.511%, 22/05/33	398 000	0,18	1 650 000 USD	Sri Lanka Government International Bond, 6.850%, 14/03/24	838 234	0,36
200 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.000%, 17/04/25	196 688	0,08	400 000 USD	Sri Lanka Government International Bond, 6.350%, 28/06/24	201 625	0,09
750 000 USD	Saudi Government International Bond, 2.900%, 22/10/25	723 516	0,31	450 000 USD	Sri Lanka Government International Bond, 6.200%, 11/05/27	225 563	0,10
900 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.750%, 18/01/28	907 312	0,39	550 000 USD	Sri Lanka Government International Bond, 6.750%, 18/04/28	275 859	0,12
300 000 USD	Saudi Government International Bond, 3.625%, 04/03/28	289 781	0,12	800 000 USD	Sri Lanka Government International Bond, 7.850%, 14/03/29	400 000	0,17
1 250 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.375%, 16/04/29	1 244 141	0,54	Sri Lanka – Total			
700 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.500%, 17/04/30	699 781	0,30	2 043 461 0,88			
200 000 USD	Saudi Government International Bond, 3.250%, 22/10/30	185 230	0,08	Tadjikistan			
1 400 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.875%, 18/07/33	1 428 000	0,61	200 000 USD	Republic of Tajikistan International Bond, 7.125%, 14/09/27	170 125	0,07
550 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.500%, 26/10/46	485 375	0,21	Tadjikistan – Total			
300 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.625%, 04/10/47	268 194	0,12	170 125 0,07			
600 000 USD	Saudi Government International Bond, 3.250%, 17/11/51	424 312	0,18	Arabie saoudite – Total			
1 400 000 USD	Saudi Government International Bond, 5.000%, 18/01/53	1 315 563	0,56	9 243 518 3,97			
400 000 USD	Saudi Government International Bond, 3.450%, 02/02/61	280 625	0,12	Sénégal			
Arabie saoudite – Total				220 000 USD Senegal Government International Bond, 6.250%, 23/05/33			
9 243 518 3,97				500 000 USD Senegal Government International Bond, 6.750%, 13/03/48			
Sénégal				Sénégal – Total			
588 281 0,25				Serbie			
Serbie				200 000 USD Serbia International Bond, 6.250%, 26/05/28			
200 000 USD Serbia International Bond, 2.125%, 01/12/30				800 000 USD Serbia International Bond, 6.500%, 26/09/33			
200 000 USD Serbia International Bond, 6.500%, 26/09/33				Serbie – Total			
1 048 684 0,45							

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)			
Trinité-et-Tobago				Turquie (suite)			
200 000 USD	Trinidad & Tobago Government International Bond, 4.500%, 04/08/26	198 563	0,09	320 000 USD	Turkiye Government International Bond, 5.750%, 11/05/47	249 600	0,11
200 000 USD	Trinidad & Tobago Government International Bond, 4.500%, 26/06/30	192 700	0,08	200 000 USD	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS, 9.375%, 31/01/26	208 812	0,09
200 000 USD	Turkiye Government International Bond, 8.600%, 24/09/27	213 000	0,09	Turquie – Total			4,31
Trinité-et-Tobago – Total			0,26	Ukraine			
Tunisie				1 250 000 USD	Ukraine Government International Bond, 7.750%, 01/09/25	360 500	0,15
400 000 USD	Tunisian Republic, 5.750%, 30/01/25	325 875	0,14	1 700 000 USD	Ukraine Government International Bond, 8.994%, 01/02/26	498 100	0,21
Tunisie – Total			0,14	1 350 000 USD	Ukraine Government International Bond, 7.750%, 01/09/28	370 575	0,16
Turquie				200 000 USD	Ukraine Government International Bond, 9.750%, 01/11/30	56 750	0,03
350 000 USD	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS, 4.489%, 25/11/24	344 531	0,15	1 400 000 USD	Ukraine Government International Bond, 6.876%, 21/05/31	317 187	0,14
200 000 USD	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS, 5.125%, 22/06/26	193 250	0,08	400 000 USD	Ukraine Government International Bond, 7.375%, 25/09/34	93 000	0,04
450 000 USD	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS, 7.250%, 24/02/27	456 750	0,20	Ukraine – Total			0,73
300 000 USD	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS, 8.509%, 14/01/29	318 150	0,14	Émirats arabes unis			
150 000 USD	Turkiye Government International Bond, 5.750%, 22/03/24	149 813	0,06	550 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 2.500%, 16/04/25	531 921	0,23
100 000 USD	Turkiye Government International Bond, 7.375%, 05/02/25	101 625	0,04	200 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 3.125%, 03/05/26	193 722	0,08
800 000 USD	Turkiye Government International Bond, 4.250%, 13/03/25	783 000	0,34	550 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 3.125%, 03/05/26	532 735	0,23
200 000 USD	Turkiye Government International Bond, 6.375%, 14/10/25	200 250	0,09	200 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 1.625%, 02/06/28	178 842	0,08
200 000 USD	Turkiye Government International Bond, 6.000%, 25/03/27	197 000	0,08	250 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 2.500%, 30/09/29	228 458	0,10
550 000 USD	Turkiye Government International Bond, 9.875%, 15/01/28	609 125	0,26	900 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 3.125%, 16/04/30	846 630	0,36
400 000 USD	Turkiye Government International Bond, 6.125%, 24/10/28	392 500	0,17	700 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 4.125%, 11/10/47	610 372	0,26
1 220 000 USD	Turkiye Government International Bond, 9.375%, 14/03/29	1 346 575	0,58	200 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 4.125%, 11/10/47	174 392	0,08
1 000 000 USD	Turkiye Government International Bond, 7.625%, 26/04/29	1 033 750	0,44	200 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 3.125%, 30/09/49	146 572	0,06
900 000 USD	Turkiye Government International Bond, 9.125%, 13/07/30	991 125	0,43	200 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 3.875%, 16/04/50	167 330	0,07
750 000 USD	Turkiye Government International Bond, 5.950%, 15/01/31	705 150	0,30	400 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 2.700%, 02/09/70	252 692	0,11
400 000 USD	Turkiye Government International Bond, 9.375%, 19/01/33	451 000	0,19	400 000 USD	Emirate of Dubai Government International Bonds, 5.250%, 30/01/43	378 500	0,16
220 000 USD	Turkiye Government International Bond, 8.000%, 14/02/34	232 100	0,10	200 000 USD	Finance Department Government of Sharjah, 3.625%, 10/03/33	169 813	0,07
280 000 USD	Turkiye Government International Bond, 6.875%, 17/03/36	267 400	0,11				
100 000 USD	Turkiye Government International Bond, 7.250%, 05/03/38	97 750	0,04				
200 000 USD	Turkiye Government International Bond, 6.750%, 30/05/40	183 000	0,08				
600 000 USD	Turkiye Government International Bond, 6.625%, 17/02/45	525 750	0,23				

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets			
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)						
Obligations d'État – 80,49 % (suite)				Obligations d'État – 80,49 % (suite)						
Émirats arabes unis (suite)				Ouzbékistan						
200 000 USD	Finance Department Government of Sharjah, 4.000%, 28/07/50	133 000	0,06	600 000 USD	Republic of Uzbekistan International Bond, 5.375%, 20/02/29	568 500	0,25			
200 000 USD	Republic of Armenia International Bond, 3.950%, 26/09/29	174 500	0,08	400 000 USD	Republic of Uzbekistan International Bond, 3.700%, 25/11/30	335 750	0,14			
300 000 USD	Republic of Armenia International Bond, 3.600%, 02/02/31	244 500	0,11	200 000 USD	Uzbekneftegaz jsc, 4.750%, 16/11/28	165 875	0,07			
200 000 USD	UAE International Government Bonds, 4.050%, 07/07/32	196 772	0,08	Ouzbékistan – Total			1 070 125	0,46		
200 000 USD	UAE International Government Bonds, 4.917%, 25/09/33	210 378	0,09	Vietnam						
600 000 USD	UAE International Government Bonds, 4.951%, 07/07/52	588 618	0,25	400 000 USD	Vietnam Government International Bond, 4.800%, 19/11/24	394 500	0,17			
Émirats arabes unis – Total			5 959 747	2,56	Vietnam – Total			394 500	0,17	
Uruguay				Zambie						
50 000 USD	Uruguay Government International Bond, 4.375%, 27/10/27	50 234	0,02	600 000 USD	Zambia Government International Bond, 8.500%, 14/04/24	372 000	0,16			
1 600 000 USD	Uruguay Government International Bond, 4.375%, 23/01/31	1 584 500	0,68	450 000 USD	Zambia Government International Bond, 8.970%, 30/07/27	277 312	0,12			
700 000 USD	Uruguay Government International Bond, 7.875%, 15/01/33	854 438	0,37	Zambie – Total			649 312	0,28		
465 000 USD	Uruguay Government International Bond, 5.750%, 28/10/34	503 363	0,21	Total des obligations d'État			187 324 282	80,49		
150 000 USD	Uruguay Government International Bond, 4.125%, 20/11/45	135 984	0,06	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				228 133 353	98,03	
1 300 000 USD	Uruguay Government International Bond, 5.100%, 18/06/50	1 302 844	0,56	TOTAL DES INVESTISSEMENTS				228 133 353	98,03	
1 000 000 USD	Uruguay Government International Bond, 4.975%, 20/04/55	975 500	0,42							
Uruguay – Total			5 406 863	2,32						

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – 0,20 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	16 254 867	20 597 000	124 811	0,05
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	BNP Paribas SA	2 759 116	3 493 000	24 338	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Citibank NA	1 700 406	2 145 000	22 688	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Goldman Sachs International	14 843 235	18 829 000	93 252	0,04
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	14 835 114	18 829 000	82 900	0,04
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	JPMorgan Chase Bank NA London	1 699 216	2 145 000	21 172	0,01
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Merrill Lynch International	14 844 721	18 829 000	95 147	0,04
Bought GBP / Sold USD, due 04/01/24	Westpac Banking Corporation	1 282 497	1 623 000	11 935	0,00
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Barclays Bank PLC	17 236 627	21 910 500	66 348	0,03
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Goldman Sachs International	16 992 248	21 622 500	42 763	0,02
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	17 002 630	21 622 500	56 000	0,02
Bought GBP / Sold USD, due 02/02/24	Royal Bank of Canada	17 005 372	21 622 500	59 496	0,03
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				700 850	0,30

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 0,20 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Barclays Bank PLC	21 622 500	17 013 975	(67 026)	(0,03)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Goldman Sachs International	21 622 500	16 995 080	(42 938)	(0,02)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	HSBC Bank PLC	21 622 500	17 005 371	(56 058)	(0,02)
Bought USD / Sold GBP, due 04/01/24	Royal Bank of Canada	21 622 500	17 008 181	(59 639)	(0,03)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(225 661)	(0,10)
Total des contrats de change à terme – couverture				475 189	0,20

Contrats à terme standardisés – 0,02 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
US 10 YEAR T-NOTE, due 19/03/24	USD	26	2 935 156	43 750	0,02
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés			2 935 156	43 750	0,02
Total des contrats à terme standardisés			2 935 156	43 750	0,02
Autres actifs/(passifs) nets				4 074 199	1,75
TOTAL DES ACTIFS NETS				232 726 491	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 11 500 USD détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

* Titre en défaut.

Tableau des investissements

au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets			
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé <i>(suite)</i>						
Obligations d'entreprise – 6,47 %				Obligations d'État – 89,91 % <i>(suite)</i>						
Azerbaïdjan				Bahreïn						
300 000 USD	Southern Gas Corridor CJSC, 6.875%, 24/03/26	304 219	0,57	800 000 USD	Bahrain Government International Bond, 5.625%, 30/09/31	750 500	1,40			
Azerbaïdjan – Total				200 000 USD	Bahrain Government International Bond, 7.500%, 20/09/47	187 875	0,35			
Îles Caïmans				1 000 000 USD	CBB International Sukuk Programme Co WLL, 4.500%, 30/03/27	968 750	1,81			
300 000 USD	EDO Sukuk Ltd, 5.875%, 21/09/33	308 812	0,58	Bahreïn – Total						
500 000 USD	Gaci First Investment Co, 4.875%, 14/02/35	487 500	0,91	1 907 125 3,56						
Îles Caïmans – Total				Bolivie						
796 312 1,49				200 000 USD				Bolivian Government International Bond, 4.500%, 20/03/28	94 600	0,18
Chili				Bolivie – Total						
500 000 USD	Corp Nacional del Cobre de Chile, 4.250%, 17/07/42	405 313	0,76	94 600 0,18						
200 000 USD	Empresa Nacional del Petroleo, 3.450%, 16/09/31	167 674	0,31	Brésil						
Chili – Total				320 000 USD				Brazilian Government International Bond, 2.875%, 06/06/25	308 600	0,58
572 987 1,07				1 100 000 USD				Brazilian Government International Bond, 6.250%, 18/03/31	1 140 678	2,13
Chine				660 000 USD				Brazilian Government International Bond, 5.625%, 07/01/41	607 860	1,13
250 000 USD	China Life Insurance Overseas Co Ltd, 5.350%, 15/08/33	252 653	0,47	Brésil – Total						
Chine – Total				2 057 138 3,84						
252 653 0,47				Îles Caïmans						
Kazakhstan				250 000 USD				Sharjah Sukuk Program Ltd, 3.234%, 23/10/29	223 828	0,42
200 000 USD	Development Bank of Kazakhstan JSC, 5.750%, 12/05/25	198 063	0,37	Îles Caïmans – Total						
Kazakhstan – Total				223 828 0,42						
198 063 0,37				Chili						
Malaisie				200 000 USD				Chile Government International Bond, 2.750%, 31/01/27	188 438	0,35
200 000 USD	Khazanah Capital Ltd, 4.876%, 01/06/33	200 516	0,37	850 000 USD	Chile Government International Bond, 2.550%, 27/07/33	702 047	1,31			
Malaisie – Total				300 000 USD	Chile Government International Bond, 4.340%, 07/03/42	267 281	0,50			
200 516 0,37				350 000 USD	Chile Government International Bond, 5.330%, 05/01/54	347 922	0,65			
Pérou				Chili – Total						
280 000 USD	Petroleos del Peru SA, 4.750%, 19/06/32	197 996	0,37	1 505 688 2,81						
Pérou – Total				Chine						
197 996 0,37				250 000 USD				China Development Bank, 0.625%, 09/09/24	242 110	0,45
Émirats arabes unis				Chine – Total						
200 000 USD	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 4.600%, 02/11/47	182 937	0,34	242 110 0,45						
250 000 USD	DP World Ltd/United Arab Emirates, 6.850%, 02/07/37	275 320	0,51	Colombie						
500 000 USD	MDGH GMTN RSC Ltd, 4.375%, 22/11/33	486 430	0,91	200 000 USD				Colombia Government International Bond, 3.875%, 25/04/27	190 563	0,35
Émirats arabes unis – Total				900 000 USD				Colombia Government International Bond, 7.500%, 02/02/34	948 094	1,77
944 687 1,76				860 000 USD				Colombia Government International Bond, 5.625%, 26/02/44	720 787	1,35
Total des obligations d'entreprise				Colombie – Total						
3 467 433 6,47				1 859 444 3,47						
Obligations d'État – 89,91 %				Argentine						
880 000 USD				Argentine Republic Government International Bond, 3.625%, 09/07/35				297 862	0,56	
1 750 000 USD				Argentine Republic Government International Bond, 3.625%, 09/07/46				601 353	1,12	
Argentine – Total				899 215 1,68						

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 89,91 % (suite)				Obligations d'État – 89,91 % (suite)			
Costa Rica				Hongrie			
200 000 USD	Costa Rica Government International Bond, 4.375%, 30/04/25	197 500	0,37	900 000 USD	Hungary Government International Bond, 5.250%, 16/06/29	904 977	1,69
800 000 USD	Costa Rica Government International Bond, 7.000%, 04/04/44	834 000	1,56	830 000 USD	Hungary Government International Bond, 7.625%, 29/03/41	992 389	1,85
Costa Rica – Total				Hongrie – Total			
1 031 500				2 151 704			
1,93				4,02			
République dominicaine				Indonésie			
550 000 USD	Dominican Republic International Bond, 5.500%, 27/01/25	546 419	1,02	950 000 USD	Indonesia Government International Bond, 2.850%, 14/02/30	857 375	1,60
300 000 USD	Dominican Republic International Bond, 6.000%, 22/02/33	294 756	0,55	700 000 USD	Indonesia Government International Bond, 6.625%, 17/02/37	818 562	1,53
1 000 000 USD	Dominican Republic International Bond, 6.500%, 15/02/48	952 000	1,78	550 000 USD	Indonesia Government International Bond, 5.125%, 15/01/45	568 391	1,06
République dominicaine – Total				Indonésie – Total			
1 793 175				2 553 328			
3,35				4,77			
Équateur				Jamaïque			
350 000 USD	Ecuador Government International Bond, 6.000%, 31/07/30	162 050	0,30	200 000 USD	Jamaica Government International Bond, 6.750%, 28/04/28	212 214	0,40
1 020 000 USD	Ecuador Government International Bond, 3.500%, 31/07/35	361 590	0,68	200 000 USD	Jamaica Government International Bond, 7.875%, 28/07/45	244 300	0,45
Équateur – Total				Jamaïque – Total			
523 640				456 514			
0,98				0,85			
Égypte				Jordanie			
620 000 USD	Egypt Government International Bond, 7.300%, 30/09/33	408 231	0,76	650 000 USD	Jordan Government International Bond, 7.500%, 13/01/29	657 312	1,23
350 000 USD	Egypt Government International Bond, 6.875%, 30/04/40	210 109	0,39	Jordanie – Total			
350 000 USD	Egyptian Financial Co for Sovereign Taskeek, 10.875%, 28/02/26	342 016	0,64	657 312			
Égypte – Total				1,23			
960 356				1,23			
1,79				0,38			
Salvador				Kazakhstan			
140 000 USD	El Salvador Government International Bond, 6.375%, 18/01/27	122 938	0,23	200 000 USD	Kazakhstan Government International Bond, 5.125%, 21/07/25	202 250	0,38
420 000 USD	El Salvador Government International Bond, 7.625%, 01/02/41	313 425	0,59	210 000 USD	Kazakhstan Government International Bond, 6.500%, 21/07/45	239 306	0,44
Salvador – Total				Kazakhstan – Total			
436 363				441 556			
0,82				0,82			
Gabon				Kenya			
200 000 USD	Gabon Government International Bond, 6.625%, 06/02/31	166 438	0,31	250 000 USD	Republic of Kenya Government International Bond, 6.300%, 23/01/34	200 625	0,37
Gabon – Total				Kenya – Total			
166 438				200 625			
0,31				0,37			
Ghana				Koweït			
650 000 USD	Ghana Government International Bond, 0.010%, 07/04/25	245 578	0,46	500 000 USD	Kuwait International Government Bond, 3.500%, 20/03/27	488 325	0,91
700 000 USD	Ghana Government International Bond, 8.750%, 11/03/61	299 906	0,56	Koweït – Total			
Ghana – Total				488 325			
545 484				0,91			
1,02				0,07			
Guatemala				Liban			
280 000 USD	Guatemala Government Bond, 4.375%, 05/06/27	267 960	0,50	600 000 USD	Lebanon Government International Bond, 7.050%, 02/11/35	35 813	0,07
Guatemala – Total				Liban – Total			
267 960				35 813			
0,50				0,07			

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 89,91 % (suite)				Obligations d'État – 89,91 % (suite)			
Malaisie				Philippines			
450 000 USD	Malaysia Wakala Sukuk Bhd, 2.070%, 28/04/31	387 518	0,72	600 000 USD	Philippine Government International Bond, 5.170%, 13/10/27	610 875	1,14
Malaisie – Total			0,72	700 000 USD	Philippine Government International Bond, 5.609%, 13/04/33	746 594	1,40
Mexique				450 000 USD	Philippine Government International Bond, 2.950%, 05/05/45	336 375	0,63
250 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.125%, 21/01/26	247 656	0,46	400 000 USD	Philippine Government International Bond, 4.200%, 29/03/47	354 500	0,66
950 000 USD	Mexico Government International Bond, 4.750%, 27/04/32	913 187	1,70	Philippines – Total			2 048 344
900 000 USD	Mexico Government International Bond, 3.771%, 24/05/61	608 344	1,14	Pologne			
Mexique – Total			3,30	300 000 USD	Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.375%, 22/05/33	303 795	0,57
Maroc				750 000 USD	Republic of Poland Government International Bond, 3.250%, 06/04/26	725 887	1,35
350 000 USD	Morocco Government International Bond, 2.375%, 15/12/27	313 031	0,58	500 000 USD	Republic of Poland Government International Bond, 5.500%, 04/04/53	520 205	0,97
200 000 USD	Morocco Government International Bond, 5.500%, 11/12/42	181 375	0,34	Pologne – Total			1 549 887
Maroc – Total			0,92	Qatar			
Oman				900 000 USD	Qatar Government International Bond, 3.250%, 02/06/26	873 000	1,63
550 000 USD	Oman Government International Bond, 4.875%, 01/02/25	545 016	1,02	1 320 000 USD	Qatar Government International Bond, 4.400%, 16/04/50	1 217 792	2,27
760 000 USD	Oman Government International Bond, 7.375%, 28/10/32	861 412	1,61	Qatar – Total			2 090 792
300 000 USD	Oman Government International Bond, 6.500%, 08/03/47	305 625	0,57	Roumanie			
Oman – Total			3,20	400 000 USD	Romanian Government International Bond, 6.625%, 17/02/28	413 012	0,77
Panama				950 000 USD	Romanian Government International Bond, 6.000%, 25/05/34	954 940	1,78
500 000 USD	Panama Government International Bond, 3.750%, 16/03/25	485 312	0,91	300 000 USD	Romanian Government International Bond, 7.625%, 17/01/53	335 196	0,63
500 000 USD	Panama Government International Bond, 2.252%, 29/09/32	364 844	0,68	Roumanie – Total			1 703 148
1 170 000 USD	Panama Government International Bond, 4.500%, 19/01/63	764 522	1,43	Arabie saoudite			
Panama – Total			3,02	750 000 USD	Saudi Government International Bond, 4.000%, 17/04/25	737 578	1,38
Paraguay				1 250 000 USD	Saudi Government International Bond, 2.250%, 02/02/33	1 033 203	1,93
350 000 USD	Paraguay Government International Bond, 3.849%, 28/06/33	309 400	0,58	670 000 USD	Saudi Government International Bond, 5.000%, 18/01/53	629 591	1,17
200 000 USD	Paraguay Government International Bond, 6.100%, 11/08/44	196 600	0,37	Arabie saoudite – Total			2 400 372
Paraguay – Total			0,95	Sénégal			
Pérou				300 000 USD	Senegal Government International Bond, 6.250%, 23/05/33	267 188	0,50
440 000 USD	Peruvian Government International Bond, 7.350%, 21/07/25	453 750	0,85	Sénégal – Total			267 188
450 000 USD	Peruvian Government International Bond, 1.862%, 01/12/32	351 563	0,66	Pérou – Total			
1 000 000 USD	Peruvian Government International Bond, 2.780%, 01/12/60	622 187	1,16	1 427 500			2,67

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets	Valeur nominale	Description	Valeur de marché	% des actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)				Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé (suite)			
Obligations d'État – 89,91 % (suite)				Obligations d'État – 89,91 % (suite)			
Serbie				Émirats arabes unis			
400 000 USD	Serbia International Bond, 2.125%, 01/12/30	319 832	0,60	950 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 3.125%, 03/05/26	920 179	1,72
Serbie – Total			0,60	400 000 USD	Abu Dhabi Government International Bond, 2.700%, 02/09/70	252 692	0,47
Afrique du Sud				200 000 USD	Finance Department Government of Sharjah, 3.625%, 10/03/33	169 813	0,32
650 000 USD	Republic of South Africa Government International Bond, 4.300%, 12/10/28	606 937	1,13	300 000 USD	UAE International Government Bonds, 2.875%, 19/10/41	227 925	0,42
400 000 USD	Republic of South Africa Government International Bond, 5.875%, 20/04/32	378 880	0,71	Émirats arabes unis – Total			1 570 609
570 000 USD	Republic of South Africa Government International Bond, 5.750%, 30/09/49	454 564	0,85	Uruguay			
Afrique du Sud – Total			2,69	1 150 000 USD	Uruguay Government International Bond, 5.750%, 28/10/34	1 244 875	2,33
Sri Lanka				700 000 USD	Uruguay Government International Bond, 5.100%, 18/06/50	701 531	1,31
850 000 USD	Sri Lanka Government International Bond, 6.850%, 03/11/25	433 234	0,81	Uruguay – Total			1 946 406
Sri Lanka – Total			0,81	Ouzbékistan			
Trinité-et-Tobago				300 000 USD	Republic of Uzbekistan International Bond, 3.700%, 25/11/30	251 813	0,47
250 000 USD	Trinidad & Tobago Government International Bond, 4.500%, 26/06/30	240 875	0,45	Ouzbékistan – Total			251 813
Trinité-et-Tobago – Total			0,45	Zambie			
Turquie				200 000 USD	Zambia Government International Bond, 8.970%, 30/07/27	123 250	0,23
600 000 USD	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS, 5.125%, 22/06/26	579 750	1,08	Zambie – Total			123 250
450 000 USD	Turkiye Government International Bond, 6.375%, 14/10/25	450 562	0,84	Total des obligations d'État			48 140 251
500 000 USD	Turkiye Government International Bond, 5.875%, 26/06/31	466 250	0,87	Total des valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse de valeurs officielle ou négociées sur un autre marché réglementé			51 607 684
450 000 USD	Turkiye Government International Bond, 5.750%, 11/05/47	351 000	0,66	TOTAL DES INVESTISSEMENTS			51 607 684
Turquie – Total			3,45				
Ukraine							
800 000 USD	Ukraine Government International Bond, 7.750%, 01/09/25	235 200	0,44				
950 000 USD	Ukraine Government International Bond, 7.750%, 01/09/28	260 775	0,49				
Ukraine – Total			0,93				

Produits dérivés

Contrats de change à terme – couverture – 1,87 %

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	BNP Paribas SA	7 993 284	9 246 000	251 159	0,47
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	7 992 733	9 246 000	250 504	0,47
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	State Street Bank London	7 993 333	9 246 000	251 218	0,47
Bought CHF / Sold USD, due 03/01/24	Westpac Banking Corporation	7 993 146	9 246 000	250 995	0,47
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	BNP Paribas SA	7 860 140	9 246 000	121 120	0,22

Tableau des investissements (suite) au 31 décembre 2023 (exprimé en dollars américains)

Produits dérivés (suite)

Contrats de change à terme – couverture – 1,87 % (suite)

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Plus-values latentes	% des actifs nets
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	Goldman Sachs International	7 860 196	9 246 000	121 186	0,23
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	HSBC Bank PLC	7 859 830	9 246 000	120 751	0,22
Bought CHF / Sold USD, due 02/02/24	State Street Bank London	7 857 040	9 246 000	117 426	0,22
Total des plus-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				1 484 359	2,77

Description	Contrepartie	Montant acheté	Montant vendu	Moins-values latentes	% des actifs nets
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	BNP Paribas SA	9 246 000	7 884 709	(122 156)	(0,23)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	Goldman Sachs International	9 246 000	7 884 711	(122 159)	(0,23)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	HSBC Bank PLC	9 246 000	7 884 573	(121 995)	(0,22)
Bought USD / Sold CHF, due 03/01/24	State Street Bank London	9 246 000	7 881 628	(118 496)	(0,22)
Total des moins-values latentes sur contrats de change à terme – couverture				(484 806)	(0,90)
Total des contrats de change à terme – couverture				999 553	1,87

Contrats à terme standardisés – 0,00 %

Description	Devise	Nombre de contrats	Engagement	Plus-values latentes	% des actifs nets
US 10 YEAR T-NOTE, due 19/03/24	USD	1	112 890	219	0,00
Plus-values latentes sur contrats à terme standardisés				219	0,00
Total des contrats à terme standardisés				112 890	0,00
Autres actifs/(passifs) nets				934 889	1,75
TOTAL DES ACTIFS NETS				53 542 345	100,00

La contrepartie des contrats à terme standardisés était Goldman Sachs & Co. La garantie détenue au titre des contrats à terme standardisés inclut 1 902 USD détenus en espèces chez Goldman Sachs & Co.

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

1. Description de la SICAV

State Street Global Advisors Luxembourg SICAV (la « SICAV ») est une SICAV d'investissement à capital variable constituée le 22 septembre 2008 selon la loi du Luxembourg du 10 août 1915 dans sa version actuelle (la « Loi de 1915 ») et agréée en tant qu'organisme de placement collectif (« OPCVM ») conformément à la Partie I de la loi du 17 décembre 2010 sur les organismes de placement collectif, dans sa version amendée (la « Loi de 2010 »).

La SICAV est structurée en fonds à compartiments multiples. Le cas échéant, des Compartiments (« Compartiments ») représentant différents portefeuilles d'investissement peuvent être créés. Chaque Compartiment peut créer diverses catégories d'actions. Les événements survenus au cours de l'exercice financier considéré (lancements et clôtures de Compartiments et de catégories d'actions) ont été listés dans le rapport. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Objectifs d'investissement

Les objectifs d'investissement indiqués ci-dessous sont donnés à titre informatif uniquement. Les objectifs d'investissement et la politique d'investissement de chaque Compartiment sont entièrement décrits dans le Prospectus.

Nom du Compartiment	Objectif d'investissement
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'État du noyau dur de la zone euro.
State Street EMU Government Bond Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'État de la zone euro.
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'État de la zone euro indexées sur l'inflation.
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise à taux fixe, de qualité investment grade et libellées en euros.
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise durables à taux fixe, de qualité investment grade et libellées en euros.
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'État mondiales.
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations mondiales.
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Répliquer la performance du marché actions japonais.
State Street Switzerland Index Equity Fund	Répliquer la performance du marché actions suisse.
State Street UK Index Equity Fund	Répliquer la performance du marché actions britannique.
State Street US Screened Index Equity Fund	Répliquer la performance du marché actions américain.
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Répliquer la performance des marchés actions de la zone euro.
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Répliquer la performance des marchés actions européens.
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Répliquer la performance des marchés actions de la région Pacifique, hors Japon.
State Street World Screened Index Equity Fund	Répliquer la performance des marchés actions développés à l'échelle mondiale.
State Street World ESG Index Equity Fund	Répliquer la performance des marchés actions développés à l'échelle mondiale.
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Répliquer la performance des marchés actions émergents à l'échelle mondiale.
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	Générer une plus-value sur le moyen à long terme via une exposition à un large éventail de classes d'actifs.
State Street Europe Value Spotlight Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des titres de participation européens.
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des titres de participation de la zone euro.
State Street US Value Spotlight Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des titres de participation de la région nord-américaine.
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des titres de participation de la région Asie-Pacifique.
State Street Global Value Spotlight Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des titres de participation mondiaux.

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

1. Description de la SICAV (suite)

Nom du Compartiment	Objectif d'investissement
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	Offrir un rendement supérieur à la performance des titres de participation mondiaux.
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	Offrir un rendement supérieur à la performance des marchés actions européens.
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	Offrir un rendement supérieur à la performance des marchés actions d'Amérique du Nord.
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	Offrir un rendement supérieur à la performance des marchés actions développés à l'échelle mondiale.
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	Offrir un rendement supérieur à la performance des actions des marchés émergents.
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Offrir un rendement supérieur à la performance des actions des marchés émergents.
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Offrir un rendement supérieur à la performance des marchés actions de la zone euro.
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	Offrir un rendement supérieur à la performance des marchés actions des sociétés européennes de petite capitalisation.
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	Offrir un rendement supérieur à la performance des actions de sociétés à petite capitalisation des marchés émergents.
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Générer des rendements de moindre volatilité et une performance comparable aux marchés actions mondiaux sur le long terme.
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	Générer une plus-value à moyen et long terme en investissant dans des titres de participation mondiaux assortis d'une faible volatilité et d'une sensibilité limitée aux replis du marché.
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'État mondiales assorties d'une échéance comprise entre 1 et 10 ans.
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Répliquer la performance des obligations souveraines des marchés émergents libellées en devise locale et éligibles à l'investissement.
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des actions émergentes.
State Street Global Opportunities Equity Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des titres de participation mondiaux.
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant sur le marché des obligations d'entreprise à taux fixe, de qualité <i>investment grade</i> et libellées en dollars américains.
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant sur le marché des obligations d'entreprise à taux fixe, de qualité <i>investment grade</i> et libellées en euros.
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'entreprise à haut rendement mondiales à taux fixe.
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	Répliquer la performance des obligations souveraines des marchés émergents libellées en devise locale et éligibles à l'investissement.
State Street US Opportunities Equity Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des titres de participation américains.
State Street China Opportunities Equity Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des actions chinoises <i>onshore</i> et <i>offshore</i> .
State Street Sustainable Climate World Equity Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des titres de participation mondiaux.
State Street Sustainable Climate US Equity Fund	Générer une plus-value à long terme en investissant dans des titres de participation américains.
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'État des marchés émergents libellées en dollars américains.
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	Répliquer la performance du marché des obligations d'État des marchés émergents libellées en dollars américains.

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

2. Synthèse des principales conventions comptables

a) Présentation des états financiers

Les états financiers sont présentés conformément à la réglementation et à la législation luxembourgeoise relative aux organismes de placement collectif selon le principe de la continuité d'exploitation à l'exception des Compartiments énumérés à la Note 13, ces Compartiments ayant été liquidés au cours de l'exercice clôturé au 31 décembre 2023. À ce titre, les états financiers de ces Compartiments ont été préparés selon le principe de la non-continuité d'exploitation.

L'application du principe de non-continuité d'exploitation comptable n'a pas entraîné d'ajustements importants de la Valeur nette d'inventaire publiée desdits Compartiments.

b) Calcul de la Valeur nette d'inventaire

La Valeur nette d'inventaire d'un Compartiment et la Valeur nette d'inventaire des Catégories d'actions émises au sein de ce Compartiment sont calculées dans la devise concernée chaque Jour de négociation. La Valeur nette d'inventaire totale d'un Compartiment représente la valeur de marché de ses actifs, déduction faite de celle de ses passifs. La Valeur nette d'inventaire par Action d'une Catégorie d'actions émises au sein d'un Compartiment est déterminée en divisant la Valeur nette d'inventaire totale de toutes les Actions de cette catégorie au sein du Compartiment concerné par le nombre total des Actions en circulation de la même catégorie du Compartiment en question. Les Valeurs nettes d'inventaire des Compartiments sont calculées conformément aux réglementations et directives en matière de valorisation exposées dans les Statuts et publiées par le Conseil d'administration.

Les présents États financiers sont présentés sur la base de la Valeur nette d'inventaire (« VNI ») calculée le 29 décembre 2023, le dernier jour ouvré de l'exercice.

c) Valorisation des investissements

La valorisation des titres détenus par un Compartiment et cotés sur une Bourse de valeurs ou un autre marché réglementé est déterminée sur la base du dernier cours disponible du marché principal sur lequel les titres en question sont négociés en faisant appel à une procédure de détermination des prix approuvée par le Conseil d'administration.

Sous réserve de dispositions contraires dans le règlement de gestion de la SICAV, la valorisation des actifs de la SICAV sera basée, dans le cas de titres admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs, sur le dernier cours de Bourse connu, à moins que cette cotation ne soit pas représentative. Pour les titres qui ne sont pas admis de la sorte sur une Bourse de valeurs ainsi que pour les titres qui sont ainsi admis sur ladite Bourse de valeurs, mais pour lesquels la dernière cotation n'est pas représentative, la valorisation sera basée sur la valeur de réalisation probable, estimée avec soin et de bonne foi.

d) Opérations de change

Les États consolidés sont présentés en euro. Les États financiers de chaque Compartiment non libellés en EUR ont été convertis en EUR, aux taux de change suivants :

État des actifs nets

Dollar australien (AUD)	1,61889	= Euro (EUR) 1,00000
Livre sterling (GBP)	0,86653	= Euro (EUR) 1,00000
Dollar canadien (CAD)	1,45659	= Euro (EUR) 1,00000
Yen japonais (JPY)	155,63968	= Euro (EUR) 1,00000
Franc suisse (CHF)	0,92973	= Euro (EUR) 1,00000
Dollar américain (USD)	1,10466	= Euro (EUR) 1,00000

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

2. Synthèse des principales conventions comptables (suite)

d) Opérations de change (suite)

Compte de résultat et État des variations des actifs nets

Dollar australien (AUD)	1,62238	= Euro (EUR) 1,00
Livre sterling (GBP)	0,86644	= Euro (EUR) 1,00
Dollar canadien (CAD)	1,45372	= Euro (EUR) 1,00
Yen japonais (JPY)	151,37486	= Euro (EUR) 1,00
Franc suisse (CHF)	0,96793	= Euro (EUR) 1,00
Dollar américain (USD)	1,08144	= Euro (EUR) 1,00

Les transactions libellées dans des devises autres que la devise propre à chaque Compartiment sont converties dans la devise dudit Compartiment aux taux de change en vigueur aux dates de transaction respectives. Les actifs et passifs libellés dans des devises autres que celle du Compartiment correspondant sont convertis dans la devise dudit Compartiment aux taux de change en vigueur au 29 décembre 2023. Les plus-values et moins-values sur opérations de change sont comptabilisées dans l'État des variations de l'actif net pour le calcul des résultats de l'exercice comptable.

e) Options, contrats à terme standardisés et contrats de swap

La valorisation des instruments dérivés est effectuée à chaque date de valorisation selon le principe de l'évaluation à la valeur de marché.

La valeur des contrats à terme standardisés cotés ou négociés sur une quelconque Bourse de valeurs repose sur le dernier prix disponible sur cette même Bourse de valeurs le Jour de valorisation applicable. La valeur des contrats à terme standardisés négociés sur un autre marché est basée sur le dernier prix disponible sur ce marché le Jour de valorisation applicable.

Dans le cas où l'un quelconque de ces actifs n'est, au Jour de valorisation, ni coté ni négocié sur une quelconque Bourse de valeurs ou autre marché ou si le prix n'est pas représentatif de la juste valeur, la valeur d'un tel actif est déterminée prudemment et en toute bonne foi sur la base de la valeur de réalisation estimée.

Les contrats à terme standardisés impliquent, à des degrés divers, un risque de perte supérieur aux valeurs reflétées dans l'État des actifs nets du Compartiment. La valeur nominale sous-jacente de tout contrat à terme standardisé ouvert à la fin de l'exercice figure dans le Tableau des investissements du Compartiment concerné. Ce montant reflète l'exposition de chaque contrat à l'instrument sous-jacent à la fin de l'exercice. Des pertes peuvent découler de variations de la valeur des instruments sous-jacents ou si les contreparties n'honorent pas leurs obligations conformément aux termes des contrats. Les bénéfices/(pertes) sont réalisé(e)s à l'expiration ou à la clôture des contrats à terme standardisés.

Parmi les risques encourus figurent les fluctuations de cours des titres sous-jacents, l'éventuel manque de liquidité du marché et/ou l'incapacité des contreparties à honorer leurs obligations contractuelles.

i) Couvertures contre les risques de marché et les risques liés à la performance boursière :

Afin de se couvrir contre de piètres performances de marché, la SICAV peut, pour chaque Compartiment, vendre des transactions à terme et des options d'achat sur des indices actions, obligations ou autres indices ou instruments financiers. Elle peut également acheter des options de vente sur des indices actions, obligations ou autres indices, ou encore acheter des instruments financiers ou conclure des swaps dans le cadre desquels les paiements entre la SICAV et la contrepartie dépendent de l'évolution de certains indices actions, obligations ou autres indices ou instruments financiers.

Comme ces opérations d'achat et de vente sont effectuées à des fins de couverture, il doit exister une corrélation suffisante entre la structure du portefeuille de titres à couvrir et la composition de l'indice boursier ainsi employé.

ii) Couvertures contre les risques liés aux taux d'intérêt :

Afin de se couvrir contre les risques liés aux fluctuations des taux d'intérêt, la SICAV peut vendre des contrats à terme sur taux d'intérêt et des options d'achat sur taux d'intérêt, acheter des options de vente sur taux d'intérêt et conclure des swaps de taux d'intérêt, des contrats de taux à terme et des options sur swaps de taux d'intérêt (swaptions) avec des établissements financiers bénéficiant d'une note élevée et qui sont spécialisés dans ce type d'opérations dans le cadre d'opérations de gré à gré pour chaque Compartiment.

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (*suite*)

2. Synthèse des principales conventions comptables (*suite*)

e) Options, contrats à terme standardisés et contrats de swap (*suite*)

iii) Opérations de couverture contre les risques d'inflation :

Afin de se couvrir contre les risques occasionnés par une accélération imprévue de l'inflation, la SICAV peut conclure des contrats appelés swaps d'inflation avec des établissements financiers bénéficiant d'une notation élevée et spécialisés dans ce type de transactions de gré à gré. Elle peut aussi utiliser d'autres instruments pour couvrir chaque Compartiment contre l'inflation.

iv) Opérations de couverture contre le risque de défaut de crédit et le risque de dégradation de la solvabilité d'un emprunteur :

Afin de se couvrir contre le risque de défaut de crédit et le risque de pertes résultant de la détérioration du niveau de solvabilité d'un emprunteur, la SICAV peut conclure des options de crédit, des swaps sur différentiels de taux (*credit spread swaps*, « CSS »), des swaps de défaut de crédit (*credit default swaps*, « CDS »), des paniers (sur indice) de CDS, des swaps de rendement total liés au crédit et autres produits dérivés de crédit de nature similaire avec des établissements financiers bénéficiant d'une notation élevée et spécialisés dans ce type de transactions de gré à gré pour chaque Compartiment.

Au 31 décembre 2023, la SICAV détenait des contrats à terme standardisés ouverts présentés en détail dans le Tableau des investissements. Elle ne comptait aucun swap ni contrat de gré à gré ouvert en fin d'exercice.

f) Opérations de mise en pension (*repos*)

La SICAV peut, en tant qu'acheteuse ou vendeuse, conclure des opérations de mise en pension. Une opération de mise en pension est un accord en vertu duquel, lors du paiement du prix d'achat, la SICAV reçoit (achète) des titres de la part d'un vendeur qui consent à les racheter à ou avant une date donnée à un prix spécifié. Une opération de mise en pension a un effet similaire à un prêt consenti par le Compartiment au vendeur et garanti par les titres. Le Compartiment n'enregistre pas l'achat des titres reçus, mais enregistre l'opération de mise en pension comme s'il s'agissait d'un prêt figurant dans l'État consolidé des actifs nets à la rubrique « Produits à recevoir pour opérations de mise en pension », y compris tous les intérêts à recevoir sur une telle transaction. Étant donné qu'une opération de mise en pension entre deux parties spécifiques impliquées est généralement prévue pour une période relativement brève et n'est pas transférable, elle n'est pas facilement négociable. Le Compartiment comptabilise les opérations de mise en pension à un coût qui, combiné aux intérêts courus, avoisine la valeur de marché. Les intérêts reçus sont enregistrés dans le Compte de résultat consolidé et dans l'État consolidé des variations des actifs nets à la rubrique « Produits d'intérêts ». La SICAV n'avait aucun accord de prise en pension en cours au 31 décembre 2023.

g) Contrats de change à terme

Chaque Compartiment peut acheter et vendre des contrats de change à terme, c'est-à-dire des accords entre deux parties portant sur l'achat la vente de devises à un prix convenu à une date future. Ces contrats sont utilisés pour se protéger contre une baisse de valeur de la devise du Compartiment comparée aux devises dans lesquelles sont libellés les titres du portefeuille ou à d'autres fins d'investissement. La valeur des contrats de change à terme est déterminée en utilisant les taux de change à terme en vigueur fournis par un service de cotation. La valeur de marché du contrat fluctuera selon les variations des taux de change. Le contrat est évalué quotidiennement à la valeur de marché et la variation de la valeur de marché est enregistrée comme plus-value ou moins-value latente. À la clôture du contrat, le Compartiment enregistre une plus-value ou moins-value réalisée égale à la différence entre la valeur du contrat au moment de son ouverture et sa valeur de clôture. Le Compartiment pourrait être exposé à un risque si la valeur de la devise évolue défavorablement, si les contreparties aux contrats sont incapables de respecter les termes contractuels ou si le Compartiment est dans l'impossibilité de contracter une position de clôture. Les risques peuvent être supérieurs aux montants comptabilisés dans l'État consolidé des actifs nets. Les contrats de change à terme éventuellement ouverts à la fin de l'exercice sont énumérés dans le Tableau des investissements des Compartiments concernés.

h) Transactions sur titres et revenus d'investissement y afférents

Les transactions sur titres sont enregistrées le jour suivant la date effective de la transaction (la date à laquelle l'ordre d'achat ou de vente est exécuté). Les plus-values ou moins-values sur les titres sont déterminées sur la base du coût moyen. Les produits d'intérêts sont comptabilisés selon la méthode de la comptabilité d'exercice. Les produits de dividendes, nets des retenues à la source applicables, sont reconnus à la date de détachement du dividende ou dès que le Compartiment est informé de ladite date. Les dividendes non numéraires sont, le cas échéant, enregistrés à la juste valeur de marché des titres reçus. Toutes les primes/remises sont amorties/cumulées sur la base du rendement à l'échéance.

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (*suite*)

2. Synthèse des principales conventions comptables (*suite*)

i) Frais d'établissement

Les frais d'établissement de Compartiment individuel peuvent être capitalisés et amortis linéairement sur une période allant jusqu'à cinq ans à partir de la date de création des Compartiments individuels.

j) Titres TBA (to-be-announced)

La SICAV peut investir dans des engagements adossés à des créances hypothécaires par l'intermédiaire de titres « TBA » (to-be-announced, ou à communiquer). Ces engagements reflètent des achats et des ventes réalisés à une date ultérieure de titres adossés à des créances hypothécaires émises (Mortgage-backed securities, « MBS ») par des agences. En fin d'exercice, aucun TBA n'était détenu.

k) Ajustement de swing pricing

La Valeur nette d'inventaire par Action d'un Compartiment peut subir une dilution si les investisseurs achètent ou vendent des Actions dudit Compartiment à des cours qui ne reflètent pas les frais de négociation et autres liés à la négociation des titres effectuée par le Gestionnaire financier en fonction des entrées ou sorties de capitaux. Afin de lutter contre cet effet, un ajustement de *swing pricing* peut être adopté pour protéger les intérêts des Actionnaires d'un Compartiment. Si, un quelconque Jour de valorisation, le total des transactions nettes en Actions d'un Compartiment est supérieur à un seuil prédéterminé, tel que défini et contrôlé périodiquement par la Société de gestion pour chaque Compartiment, la Valeur nette d'inventaire par Action peut être ajustée à la hausse ou à la baisse pour correspondre respectivement aux entrées nettes ou sorties nettes.

Les entrées nettes et sorties nettes seront déterminées par la Société de gestion sur la base des dernières informations disponibles au moment du calcul de la Valeur nette d'inventaire par Action. Un ajustement de swing pricing peut être appliqué à l'ensemble des Compartiments, tel que défini dans le Prospectus. La Société de gestion fixera le périmètre de l'ajustement de prix afin qu'il corresponde aux frais de négociation et autres. Cet ajustement peut varier d'un Compartiment à l'autre et ne dépassera pas 3 % de la Valeur nette d'inventaire par Action d'origine. La Valeur nette d'inventaire par Action officielle à la fin de l'exercice, communiquée dans la section « Informations statistiques » du présent rapport, peut donc inclure un ajustement de swing pricing, qui ne sera pas comptabilisé dans l'État de l'actif net, ni dans le Compte de résultat ni l'État des variations de l'actif net.

À la fin de l'exercice, un ajustement de swing pricing avait été appliqué aux Compartiments suivants, comme suit :

Compartiments	Devise	VNI avant ajustement de swing pricing	Ajustement de swing pricing	VNI après ajustement de swing pricing
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	6 675 453 368	6 675 453	6 682 128 821
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	4 672 472 863	1 868 989	4 674 341 852
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	622 915 775	1 121 248	624 037 023
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	304 048 002	121 619	304 169 621
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	86 676 854	43 338	86 720 192
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	4 765 563 709	1 906 225	4 767 469 934
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	USD	2 274 242 936	1 819 394	2 276 062 330
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	USD	232 726 491	1 396 365	234 122 856

3. Commissions et frais

a) Commissions du Dépositaire, de l'Agent d'administration centrale, de l'Agent de registre et de transfert et de l'Agent payeur

Les commissions payables au Dépositaire, à l'Agent d'administration centrale, l'Agent de registre et de transfert et à l'Agent payeur s'entendent aux taux et/ou montants convenus le cas échéant avec la SICAV. La commission maximale payable par Compartiment au Dépositaire s'élève à 0,004 % par an et à 0,025 % par an pour l'Agent d'administration centrale, l'Agent de registre et de transfert et l'Agent payeur (hors commissions spécifiques à verser au titre du traitement de plusieurs Catégories d'actions), dans chaque cas sur la base de la Valeur nette d'inventaire du Compartiment concerné.

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

3. Commissions et frais (suite)

a) Commissions du Dépositaire, de l'Agent d'administration centrale, de l'Agent de registre et de transfert et de l'Agent payeur (suite)

En outre, le Dépositaire et l'Agent d'administration centrale, l'Agent payeur, ainsi que l'Agent de registre et de transfert ont droit, selon le cas, à des frais par transaction, à une commission forfaitaire au titre de certains services ou produits, à des remboursements par la SICAV pour dépenses et débours encourus et autres charges de tout correspondant.

b) Commission de gestion financière

Les Compartiments énumérés dans le présent rapport, financés au 31 décembre 2023, sont assortis des Commissions de gestion financière maximales suivantes :

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	Commission de gestion financière, en %
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,15 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,15 %
	Catégorie P (EUR)	0,30 %
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,15 %
	Catégorie P (EUR)	0,30 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	0,30 %
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	0,15 %
	Catégorie P (EUR)**	0,30 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,15 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,15 %
	Catégorie P (EUR)	0,30 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	0,30 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,20 %
	Catégorie S (EUR)	0,05 %
	Catégorie A2 (EUR)**	0,07 %
	Catégorie A2 Distribution (EUR)**	0,16 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,00 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,18 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,18 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	0,18 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SGD)	0,18 %
	Catégorie I (USD)	0,15 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,18 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,18 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	0,18 %
Catégorie P (USD)	0,30 %	
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,00 %
	Catégorie B (Portefeuille couvert en GBP)	0,00 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,18 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,18 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	0,18 %
	Catégorie I (USD)	0,15 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)*	0,18 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,18 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (*suite*)

3. Commissions et frais (*suite*)

b) Commission de gestion financière (*suite*)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	Commission de gestion financière, en %
State Street Canada Index Equity Fund	Catégorie I (CAD)**	0,00 %
	Catégorie I (EUR)**	0,00 %
	Catégorie P (CAD)**	0,00 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B (JPY)**	0,00 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I (JPY)	0,20 %
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie P (JPY)	0,60 %
	Catégorie A (CHF)	0,30 %
	Catégorie I (CHF)	0,20 %
	Catégorie P (CHF)	0,60 %
	Catégorie P (EUR)	0,60 %
State Street UK Index Equity Fund	Catégorie S (CHF)	0,12 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I (GBP)	0,20 %
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie P (GBP)	0,60 %
	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie B Distribution (GBP)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I (VNI couverte en EUR)	0,22 %
	Catégorie I (USD)	0,20 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie P (USD)	0,60 %
	Catégorie A (EUR)	0,30 %
	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,20 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie P (EUR)	0,60 %
	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie B Distribution (GBP)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,20 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie P (EUR)	0,60 %
	Catégorie B (USD)**	0,00 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,00 %
	Catégorie I (USD)	0,20 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie P (USD)	0,60 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

3. Commissions et frais (suite)

b) Commission de gestion financière (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	Commission de gestion financière, en %
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie B (Portefeuille couvert en USD)	0,00 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,00 %
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en USD)*	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,23 %
	Catégorie I (GBP)	0,20 %
	Catégorie I (SEK)	0,20 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SEK)	0,23 %
	Catégorie I (USD)	0,20 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en CHF)	0,23 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,23 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,23 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,23 %
	Catégorie I Distribution (USD)*	0,20 %
	Catégorie P (Portefeuille couvert en EUR)	0,63 %
	Catégorie P (SEK)	0,60 %
	Catégorie P (Portefeuille couvert en SEK)	0,63 %
Catégorie P (USD)	0,60 %	
Catégorie S (USD)	0,07 %	
Catégorie S Distribution (USD)	0,07 %	
State Street World ESG Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,23 %
	Catégorie I (USD)	0,20 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,00 %
	Catégorie I (GBP)	0,30 %
	Catégorie I (SEK)	0,30 %
	Catégorie I (USD)	0,30 %
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	Catégorie P (USD)	1,20 %
	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,55 %
State Street Europe Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	1,10 %
	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,75 %
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	1,50 %
	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,75 %
State Street US Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	1,50 %
	Catégorie B (EUR)	0,00 %
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund	Catégorie I (USD)	0,75 %
	Catégorie B (EUR)	0,00 %
State Street Global Value Spotlight Fund	Catégorie I (EUR)	0,75 %
	Catégorie I (USD)	0,75 %
	Catégorie P (EUR)	1,50 %
	Catégorie B (USD)	0,00 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)	0,00 %
	Catégorie I (USD)	0,35 %
	Catégorie B (USD)	0,00 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

3. Commissions et frais (suite)

b) Commission de gestion financière (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	Commission de gestion financière, en %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (EUR)	0,30 %
	Catégorie P (EUR)	0,50 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,30 %
	Catégorie P (USD)	0,50 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,35 %
	Catégorie I Distribution (USD)	0,35 %
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,45 %
	Catégorie I (EUR)	0,45 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie B (GBP)	0,00 %
	Catégorie B (USD)**	0,00 %
	Catégorie I (USD)	0,45 %
	Catégorie I (EUR)**	0,45 %
	Catégorie P (EUR)	0,95 %
	Catégorie P (USD)	0,95 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie I (EUR)	0,50 %
	Catégorie P (EUR)	1,50 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	1,50 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P (EUR)	1,50 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	1,50 %
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie A (USD)	1,20 %
	Catégorie I (EUR)	1,10 %
	Catégorie I (USD)	1,10 %
	Catégorie P (USD)	2,20 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie A (USD)	0,45 %
	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,35 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,38 %
	Catégorie I (USD)	0,35 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,35 %
	Catégorie P (USD)	0,90 %
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie B (USD)**	0,00 %
	Catégorie I (USD)	0,75 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,08 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,08 %
	Catégorie I (USD)	0,06 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	0,08 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,08 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,08 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,08 %
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie I (USD)	0,15 %
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	Catégorie I (EUR)**	0,75 %
	Catégorie I (USD)	0,75 %
	Catégorie P (EUR)	1,35 %
	Catégorie P (USD)	1,35 %
State Street Global Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,50 %
	Catégorie B (USD)**	0,00 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

3. Commissions et frais (suite)

b) Commission de gestion financière (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	Commission de gestion financière, en %
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	Catégorie I (couverte en EUR)	0,22 %
	Catégorie I (USD)	0,20 %
	Catégorie P (USD)**	0,40 %
	Catégorie S (USD)	0,15 %
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie B (EUR)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,20 %
	Catégorie P (EUR)	0,40 %
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie B (Portefeuille couvert en EUR)	0,00 %
	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,18 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,18 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en NOK)	0,18 %
	Catégorie I (USD)	0,15 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	0,18 %
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie B Distribution (GBP)	0,00 %
	Catégorie I (EUR)	0,15 %
	Catégorie I (USD)	0,15 %
	Catégorie I Distribution (USD)	0,15 %
State Street US Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,50 %
State Street China Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,75 %
State Street Sustainable Climate World Equity Fund	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,00 %
	Catégorie I (USD)	0,30 %
State Street Sustainable Climate US Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,30 %
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	0,15 %
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,00 %
	Catégorie I (USD)	0,15 %
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)*	0,17 %
	Catégorie I (USD)*	0,15 %

* Cette catégorie d'actions a été lancée durant l'exercice clôturé le 31 décembre 2023. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

** Cette catégorie d'actions a été fermée durant l'exercice clôturé le 31 décembre 2023. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Ces Commissions de gestion financière seront provisionnées quotidiennement sur la base de la Valeur nette d'inventaire des Compartiments le Jour de négociation correspondant et payées mensuellement à terme échu.

Le total des frais sur encours (« TER » pour *Total Expense Ratio*) attribuable aux Catégories d'actions des Compartiments, tels qu'établis ci-dessous, intègrent les commissions et frais du Gestionnaire financier, de l'Agent d'administration centrale, du Dépositaire, toute commission de distribution non couverte par la Commission de souscription le cas échéant ainsi que certains autres frais du Compartiment concerné visés dans le Prospectus.

La Société de gestion a convenu de rembourser une part de ses commissions, tel que nécessaire, pour garantir que les totaux des frais sur encours attribuables à toutes les Actions ne dépassent pas actuellement les taux visés ci-après. Les Actionnaires seront préalablement informés en cas d'interruption de ces

remboursements par la Société de gestion.

State Street Global Advisors Luxembourg SICAV
Rapport annuel et États financiers audités 2023

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

3. Commissions et frais (suite)

b) Commission de gestion financière (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023	TER maximum, en %
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	0,05 %	0,07 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %	0,22 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,20 %	0,22 %
	Catégorie P (EUR)	0,35 %	0,40 %
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	(0,19 %)	0,05 %
	Catégorie I (EUR)	0,02 %	0,20 %
	Catégorie P (EUR)	0,11 %	0,40 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	0,11 %	0,40 %
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	0,25 %	0,25 %
	Catégorie P (EUR)**	s/o	s/o
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie B (EUR)	0,04 %	0,04 %
	Catégorie I (EUR)	0,19 %	0,19 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,19 %	0,19 %
	Catégorie P (EUR)	0,34 %	0,40 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	0,34 %	0,40 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	0,26 %	0,26 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,26 %	0,26 %
	Catégorie S (EUR)	0,11 %	0,11 %
	Catégorie A2 (EUR)**	s/o	s/o
	Catégorie A2 Distribution (EUR)**	0,13 %	0,11 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	0,05 %	0,06 %
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,05 %	0,07 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,23 %	0,25 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,23 %	0,25 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	0,23 %	0,25 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SGD)	0,23 %	0,25 %
	Catégorie I (USD)	0,20 %	0,21 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,23 %	0,25 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,23 %	0,25 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	0,23 %	0,25 %
	Catégorie P (USD)	0,35 %	0,40 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,03 %	0,06 %
	Catégorie B (Portefeuille couvert en GBP)	0,03 %	0,06 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,21 %	0,24 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,21 %	0,24 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	0,21 %	0,24 %
	Catégorie I (USD)	0,18 %	0,20 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)*	0,21 %	0,24 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,21 %	0,24 %
State Street Canada Index Equity Fund	Catégorie I (CAD)**	s/o	s/o
	Catégorie I (EUR)**	s/o	s/o
	Catégorie P (CAD)**	s/o	s/o
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B (JPY)**	s/o	s/o
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,30 %	0,30 %
	Catégorie I (JPY)	0,30 %	0,30 %
	Catégorie P (JPY)	0,70 %	0,70 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

3. Commissions et frais (suite)

b) Commission de gestion financière (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023	TER maximum, en %
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie A (CHF)	0,40 %	0,40 %
	Catégorie I (CHF)	0,30 %	0,30 %
	Catégorie P (CHF)	0,70 %	0,70 %
	Catégorie P (EUR)	0,69 %	0,70 %
	Catégorie S (CHF)	0,17 %	0,17 %
State Street UK Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	0,30 %	0,30 %
	Catégorie I (GBP)	0,30 %	0,30 %
	Catégorie P (GBP)	0,70 %	0,70 %
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	0,04 %	0,05 %
	Catégorie B Distribution (GBP)	0,04 %	0,06 %
	Catégorie I (VNI couverte en EUR)	0,26 %	0,28 %
	Catégorie I (EUR)	0,24 %	0,25 %
	Catégorie I (USD)	0,24 %	0,25 %
	Catégorie P (USD)	0,64 %	0,70 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie A (EUR)	0,40 %	0,40 %
	Catégorie B (EUR)	0,06 %	0,06 %
	Catégorie I (EUR)	0,26 %	0,26 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,26 %	0,26 %
	Catégorie P (EUR)	0,70 %	0,70 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie B (EUR)	0,05 %	0,05 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,05 %	0,06 %
	Catégorie I (EUR)	0,25 %	0,25 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,25 %	0,25 %
	Catégorie P (EUR)	0,67 %	0,70 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	(0,86 %)	0,10 %
	Catégorie B (USD)**	s/o	s/o
	Catégorie I (EUR)	0,18 %	0,30 %
	Catégorie I (USD)	0,17 %	0,30 %
	Catégorie P (USD)	0,56 %	0,70 %
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie B (Distribution couverte en GBP)*	0,04 %	0,05 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,03 %	0,04 %
	Catégorie B (USD)	0,04 %	0,04 %
	Catégorie B (Portefeuille couvert en USD)	0,04 %	0,05 %
	Catégorie I (EUR)	0,24 %	0,24 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,27 %	0,28 %
	Catégorie I (GBP)	0,24 %	0,24 %
	Catégorie I (SEK)	0,23 %	0,24 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SEK)	0,27 %	0,28 %
	Catégorie I (USD)	0,24 %	0,24 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en CHF)	0,27 %	0,28 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,27 %	0,28 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,27 %	0,28 %
	Catégorie I Distribution (USD)*	0,22 %	0,24 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,27 %	0,28 %
	Catégorie P (Portefeuille couvert en EUR)	0,67 %	0,73 %
	Catégorie P (SEK)	0,63 %	0,70 %
	Catégorie P (Portefeuille couvert en SEK)	0,67 %	0,73 %
	Catégorie P (USD)	0,64 %	0,70 %
Catégorie S (USD)	0,10 %	0,10 %	
Catégorie S Distribution (USD)	0,10 %	0,10 %	

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

3. Commissions et frais (suite)

b) Commission de gestion financière (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023	TER maximum, en %
State Street World ESG Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	0,05 %	0,07 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,29 %	0,31 %
	Catégorie I (USD)	0,25 %	0,27 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,09 %	0,10 %
	Catégorie B (USD)	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (GBP)	0,40 %	0,40 %
	Catégorie I (SEK)	0,40 %	0,40 %
	Catégorie I (USD)	0,40 %	0,40 %
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	Catégorie P (USD)	1,35 %	1,35 %
	Catégorie B (EUR)	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,65 %	0,65 %
State Street Europe Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	1,24 %	1,24 %
	Catégorie B (EUR)	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,85 %	0,85 %
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	1,64 %	1,64 %
	Catégorie B (EUR)	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,85 %	0,85 %
State Street US Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	1,64 %	1,64 %
	Catégorie B (EUR)	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (USD)	0,85 %	0,85 %
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (USD)	0,85 %	0,85 %
State Street Global Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,85 %	0,85 %
	Catégorie I (USD)	0,85 %	0,85 %
	Catégorie P (EUR)	1,64 %	1,64 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	Catégorie B (USD)	0,07 %	0,10 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (USD)	0,45 %	0,45 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (EUR)	0,38 %	0,40 %
	Catégorie P (EUR)	0,40 %	0,64 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,36 %	0,40 %
	Catégorie P (USD)	(0,44 %)	0,64 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,45 %	0,45 %
	Catégorie I Distribution (USD)	0,45 %	0,45 %
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	Catégorie I (EUR)	0,55 %	0,70 %
	Catégorie I (USD)	0,55 %	0,70 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie B (GBP)	0,06 %	0,25 %
	Catégorie B (USD)**	s/o	s/o
	Catégorie I (EUR)	0,57 %	0,70 %
	Catégorie I (USD)	0,52 %	0,70 %
	Catégorie P (EUR)	1,06 %	1,24 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie P (USD)	1,11 %	1,24 %
	Catégorie I (EUR)	0,60 %	0,60 %
	Catégorie P (EUR)	1,64 %	1,64 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	1,64 %	1,64 %
	Catégorie P (EUR)	1,64 %	1,64 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	1,64 %	1,64 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

3. Commissions et frais (suite)

b) Commission de gestion financière (suite)

Name of the Fund	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023	TER maximum, en %
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie A (USD)	1,48 %	1,49 %
	Catégorie I (EUR)	1,35 %	1,35 %
	Catégorie I (USD)	1,34 %	1,35 %
	Catégorie P (USD)	2,48 %	2,49 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie A (USD)	0,56 %	0,59 %
	Catégorie B (USD)	0,09 %	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,43 %	0,45 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,46 %	0,48 %
	Catégorie I (USD)	0,43 %	0,45 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,43 %	0,45 %
	Catégorie P (USD)	1,03 %	1,04 %
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	Catégorie B (EUR)	0,10 %	0,10 %
	Catégorie B (USD)**	s/o	s/o
	Catégorie I (USD)	0,85 %	0,85 %
State Street Global Treasury 1- 10 Year Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,12 %	0,15 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,13 %	0,15 %
	Catégorie I (USD)	0,11 %	0,12 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	0,13 %	0,15 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,13 %	0,15 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,13 %	0,15 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,13 %	0,15 %
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (USD)	0,15 %	0,30 %
	Catégorie B (USD)	0,00 %	0,15 %
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	Catégorie I (EUR)**	s/o	s/o
	Catégorie I (USD)	0,43 %	1,00 %
	Catégorie P (EUR)	1,09 %	1,64 %
	Catégorie P (USD)	1,05 %	1,64 %
State Street Global Opportunities Equity Fund	Catégorie B (USD)**	s/o	s/o
	Catégorie I (USD)	0,60 %	0,60 %
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	Catégorie I (USD)	0,20 %	0,30 %
	Catégorie I (couverte en EUR)	0,26 %	0,33 %
	Catégorie P (USD)**	s/o	s/o
	Catégorie S (USD)	0,13 %	0,25 %
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie B (EUR)	(0,02 %)	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %	0,30 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,23 %	0,30 %
	Catégorie P (EUR)	0,49 %	0,54 %
	Catégorie S (EUR)	0,12 %	0,25 %
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie B (Portefeuille couvert en EUR)	0,11 %	0,11 %
	Catégorie B (USD)	0,10 %	0,10 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,29 %	0,29 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,29 %	0,29 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en NOK)	0,29 %	0,29 %
	Catégorie I (USD)	0,25 %	0,25 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	0,29 %	0,29 %
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,28 %	0,29 %	

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

3. Commissions et frais (suite)

b) Commission de gestion financière (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023	TER maximum, en %
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,11 %	0,15 %
	Catégorie B (USD)	0,09 %	0,15 %
	Catégorie I (EUR)	0,24 %	0,30 %
	Catégorie I (USD)	0,26 %	0,30 %
	Catégorie I Distribution (USD)	0,24 %	0,30 %
State Street US Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,60 %	0,60 %
State Street China Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	(0,51 %)	0,90 %
State Street Sustainable Climate World Class Equity Fund	B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,11 %	0,11 %
	Catégorie I (USD)	0,38 %	0,40 %
State Street Sustainable Climate US Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,40 %	0,40 %
State Street Emerging Markets Hard Class Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	0,10 %	0,10 %
	B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,04 %	0,11 %
	Catégorie I (USD)	0,20 %	0,25 %
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)*	0,30 %***	0,28 %
	Catégorie I (USD)*	0,27 %***	0,25 %

*Cette catégorie d'actions a été lancée durant l'exercice clôturé le 31 décembre 2023. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

** Cette catégorie d'actions a été fermée durant l'exercice clôturé le 31 décembre 2023. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

*** À la fin de l'exercice, le TER est supérieur au TER maximum, car deux catégories d'actions ont été lancées le 15 décembre 2023. C'est cette annualisation de 10 jours d'activité qui entraîne ces problèmes d'arrondi.

c) Autres charges

Les autres frais figurant dans le Compte de résultat consolidé comprennent, entre autres, les coûts liés aux droits d'enregistrement, aux frais de traduction et de publication.

d) Honoraires des Administrateurs

Le montant total des rémunérations des Administrateurs pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 était de 45 000 EUR par administrateur. Les Administrateurs qui sont également employés du Gestionnaire financier ou de l'une de ses sociétés affiliées ne sauraient avoir droit à des jetons de présence.

4. Fiscalité

La SICAV est soumise à la compétence de l'administration fiscale du Luxembourg. Conformément à la loi et aux pratiques actuelles du Luxembourg, la SICAV n'est assujettie ni à l'impôt sur le revenu ni à un quelconque impôt sur les plus-values de capital concernant les bénéfices de valorisation réalisés ou non réalisés. Aucun impôt n'est dû au Luxembourg sur l'émission d'Actions.

La Valeur nette d'inventaire correspondant aux Actions « P » et « A » (Actions offertes aux investisseurs de détail et aux investisseurs institutionnels) est assujettie à une taxe d'abonnement, au taux annuel de 0,05 % de la Valeur nette d'inventaire calculée à la fin de chaque trimestre, et payable trimestriellement par le Compartiment. Les Catégories d'actions « P » et « A » sont offertes aux investisseurs de détail et institutionnels. Dans la mesure où une partie des actifs de la SICAV est investie dans d'autres OPCVM luxembourgeois assujettis à la taxe d'abonnement, les actifs ne seront pas assujettis à un impôt additionnel.

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

4. Fiscalité (suite)

La Valeur nette d'inventaire correspondant aux Actions « I » et « B » (Actions offertes aux investisseurs institutionnels) est soumise à un taux d'imposition réduit de 0,01 % par an, payable trimestriellement par le Compartiment, dans la mesure où la SICAV considère les investisseurs de cette Catégorie d'actions comme des investisseurs institutionnels au sens des Articles 174 à 176 de la Loi de 2010. Cette classification se fonde sur la situation juridique actuelle telle qu'elle est comprise par la SICAV.

Les plus-values de capital et revenus provenant de dividendes, d'intérêts et de paiements d'intérêts produits dans d'autres pays peuvent être soumis à une retenue à la source non recouvrable ou assujettis à un impôt sur les plus-values de capital dans lesdits pays. Les effets fiscaux sont enregistrés selon la méthode de la comptabilité de caisse. Toutefois, une supervision quotidienne est assurée au niveau desdits soldes afin de s'assurer que d'éventuelles provisions importantes appropriées soient reflétées en conséquence.

Conformément à l'article 175 de la Loi de 2010, une catégorie d'actions qui fait l'objet d'une cotation en Bourse et relève d'un Compartiment qui réplique la performance d'un indice n'est pas assujettie à la taxe d'abonnement. La taxe d'abonnement correspond à un droit d'enregistrement établi sur la négociabilité des titres émis par les organismes de placement collectif.

Au 31 décembre 2023, les Catégories d'actions suivantes n'étaient pas assujetties à la taxe d'abonnement :

Nom du Compartiment	Catégories d'actions
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I Distribution (EUR)
	Catégorie P (EUR)
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie P (EUR)
	Catégorie P Distribution (EUR)
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie B (EUR)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie P (EUR)
	Catégorie P Distribution (EUR)
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie A2 Distribution (EUR)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I Distribution (EUR)
	Catégorie S (EUR)
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (USD)
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SGD)
	Catégorie I (USD)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)
Catégorie P (USD)	
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie B (Portefeuille couvert en GBP)
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)
	Catégorie I (USD)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

4. Fiscalité (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I (JPY)
	Catégorie P (JPY)
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie A (CHF)
	Catégorie I (CHF)
	Catégorie P (CHF)
	Catégorie P (EUR)
	Catégorie S (CHF)
State Street UK Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I (GBP)
	Catégorie P (GBP)
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)
	Catégorie B Distribution (GBP)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I (VNI couverte en EUR)
	Catégorie I (USD)
	Catégorie P (USD)
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie A (EUR)
	Catégorie B (EUR)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I Distribution (EUR)
	Catégorie P (EUR)
	Catégorie B (EUR)
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I Distribution (EUR)
	Catégorie P (EUR)
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I (USD)
	Catégorie P (USD)
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)
	Catégorie B (Portefeuille couvert en USD)
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)
	Catégorie B Distribution (GBP)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie I (GBP)
	Catégorie I (SEK)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SEK)
	Catégorie I (USD)
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en CHF)
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)
	Catégorie I Distribution (USD)
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)
	Catégorie P (Portefeuille couvert en EUR)
Catégorie P (SEK)	
Catégorie P (Portefeuille couvert en SEK)	
Catégorie P (USD)	
Catégorie S (USD)	
Catégorie S Distribution (USD)	

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

4. Fiscalité (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions
State Street World ESG Index Equity Fund	Catégorie B (USD)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie I (USD)
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)
	Catégorie B Distribution (GBP)
	Catégorie I (GBP)
	Catégorie I (SEK)
	Catégorie I (USD)
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie P (USD)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie I (USD)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)
	Catégorie B (USD)
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie I (USD)
	Catégorie B (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie B (USD)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en NOK)
	Catégorie I (USD)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)
	Catégorie B Distribution (GBP)
	Catégorie I (EUR)
	Catégorie I (USD)
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (USD)
	Catégorie B (USD)
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (USD)
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)
	Catégorie I (USD)

*Cette catégorie d'actions a été lancée durant l'exercice clôturé le 31 décembre 2023. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

5. Modifications apportées au Portefeuille d'investissement

La liste de toutes les cessions et acquisitions du portefeuille d'investissement au cours de l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 est disponible pour consultation aux sièges sociaux de la SICAV. Un exemplaire peut être fourni.

6. Frais de transaction

Au titre de l'exercice courant du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023, la SICAV a engagé des frais de transaction liés à l'achat et à la vente de valeurs mobilières. Le tableau ci-dessous représente les frais de transaction pouvant être identifiés séparément.

Nom du Compartiment	Devise de référence du Compartiment	Frais de transaction
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	2 590
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	5 767
State Street Canada Index Equity Fund ^(b)	CAD	12 832

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

6. Frais de transaction (suite)

Nom du Compartiment	Devise de référence du Compartiment	Frais de transaction
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	1 931 854
State Street Switzerland Index Equity Fund	CHF	63 908
State Street UK Index Equity Fund	GBP	151 873
State Street US Screened Index Equity Fund	USD	10 903
State Street EMU Screened Index Equity Fund	EUR	84 505
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	245 053
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	12 085
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	195 146
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	423 411
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	499 899
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	EUR	277
State Street Europe Value Spotlight Fund	EUR	49 623
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	EUR	25 737
State Street US Value Spotlight Fund	USD	3 806
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund	USD	39 122
State Street Global Value Spotlight Fund	EUR	112 582
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	175 853
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	EUR	315 374
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	47 948
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	26 656
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	USD	1 038 209
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	886 956
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	EUR	38 125
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	EUR	36 584
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	USD	216 417
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	USD	50 297
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	USD	47 224
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	42 821
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	USD	62 134
State Street Global Opportunities Equity Fund	USD	64 239
State Street US Opportunities Equity Fund	USD	633
State Street China Opportunities Equity Fund	USD	3 730
State Street Sustainable Climate World Equity Fund	USD	71 201
State Street Sustainable Climate US Equity Fund	USD	113

^(b)Ce Compartiment a été liquidé au cours de l'exercice. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Les frais de transaction ont été définis comme des commissions de courtage, des frais de Bourse et taxes relatifs à l'achat ou à la vente de titres de participation et investissements dans d'autres fonds. Pour la plupart des obligations, ces frais sont inclus dans le prix des obligations et ne peuvent donc pas être isolés, sauf pour les Compartiments State Street Global Aggregate Bond Index Fund et State Street Global Treasury Bond Index Fund au sein desquels les frais de transaction sont identifiables séparément.

7. Dividendes distribués

Au cours de l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, la SICAV a résolu de verser aux Actionnaires des Compartiments susmentionnés des dividendes, tel que suit :

Compartiment	Catégorie	Date de détachement du dividende	Date de paiement	Devise	Dividende par Action	Dividendes distribués
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (USD)	18/04/23	20/04/23	USD	0,39	191 363

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

7. Dividendes distribués (suite)

Compartiment	Catégorie	Date de détachement du dividende	Date de paiement	Devise	Dividende par Action	Dividendes distribués
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,22	41 460
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,29	196 641
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,02	20 933
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,01	21 188
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,09	132 896
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,11	970 519
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,09	12 886
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie A2 Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,09	1 714 611
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,35	4 305 749
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,34	32 090
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I Distribution (USD)	18/04/23	20/04/23	USD	0,23	11 254
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,24	869 061
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	18/04/23	20/04/23	USD	0,08	1 089 848
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	18/04/23	20/04/23	GBP	0,07	2 589 621
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,07	180 305
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	18/04/23	20/04/23	GBP	0,10	847 887
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,9	14 006

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

7. Dividendes distribués (suite)

Compartiment	Catégorie	Date de détachement du dividende	Date de paiement	Devise	Dividende par Action	Dividendes distribués
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,05	27 762
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	18/04/23	20/04/23	EUR	0,03	4 219
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	18/04/23	20/04/23	USD	0,13	392 644
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en CHF)	18/04/23	20/04/23	CHF	0,12	638 051
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	18/04/23	20/04/23	GBP	0,13	72 566
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie S Distribution (USD)	18/04/23	20/04/23	USD	0,20	2 197 378
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	18/04/23	20/04/23	GBP	0,48	6 972 749

8. Ajustement de change

La valeur d'ouverture de la SICAV a été redéfinie au taux de change en vigueur au 31 décembre 2023. La moins-value qui en résulte, d'un montant de 851 594 762 EUR, représente la variation des taux de change entre le 1^{er} janvier 2023 et le 31 décembre 2023. Il s'agit là d'une perte de change qui n'a aucune incidence sur la Valeur nette d'inventaire des Compartiments individuels.

9. Investissements croisés

Un Compartiment peut acquérir des actions d'un ou plusieurs autres Compartiments de la SICAV (le Compartiment cible), pour autant qu'il n'y ait pas de duplication des commissions entre les commissions imputées au niveau du Compartiment ayant investi dans le Compartiment cible et les commissions imputées au niveau du Compartiment cible.

La valeur de ces investissements croisés par Compartiment au 31 décembre 2023 est la suivante :

Nom du Compartiment	Devise	Valeur de marché en EUR
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	USD	5 805 326
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	EUR	4 872 236
	Total	10 677 562

Au 31 décembre 2023, le total des investissements croisés des Compartiments s'élève à 10 677 562 EUR et de ce fait, la VNI combinée totale à la fin de l'exercice hors investissements croisés s'établit à 31 812 374 213 EUR.

10. Prêt de titres

La SICAV a nommé State Street Bank International GMBH et State Street Bank and Trust Company pour intervenir en tant qu'Agents de prêt de titres. Les titres sont prêtés à leurs Contreparties agréées, et la garantie doit être suffisamment liquide et valorisée quotidiennement à la valeur de marché.

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Les titres de participation ne seront acceptés en garantie que s'ils sont admis à la cote officielle d'une Bourse de valeurs dans un État membre ou un État tiers ou négociés sur un marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu officiellement et ouvert au public dans un État membre ou un État tiers. « État membre » désigne un État membre de l'Union européenne.

Le tableau suivant constitue une synthèse de la valeur des titres prêtés, analysée par contrepartie emprunteuse au 31 décembre 2023 :

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	EUR	Barclays PLC	Royaume-Uni	34 653 405	5,32 %	5,37 %
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	EUR	BNP Paribas SA	France	8 633 475	1,33 %	1,34 %
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	EUR	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	7 108 779	1,09 %	1,1 %
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	EUR	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	24 627 306	3,78 %	3,82 %
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	EUR	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	16 406 815	2,52 %	2,54 %
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	EUR	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	3 400 763	0,52 %	0,53 %
State Street EMU Government Bond Index Fund	EUR	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	4 241 767	1,6 %	1,62 %
State Street EMU Government Bond Index Fund	EUR	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	762 390	0,29 %	0,29 %
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	EUR	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	2 118 488	3,08 %	3,09 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	Barclays PLC	Royaume-Uni	18 194 010	2,13 %	2,16 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	BNP Paribas SA	France	4 246 620	0,5 %	0,5 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	5 561 853	0,65 %	0,66 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	2 061 734	0,24 %	0,24 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	1 271 878	0,15 %	0,15 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	ING Bank NV	Pays-Bas	893 183	0,1 %	0,11 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	2 012 271	0,24 %	0,24 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	1 532 000	0,18 %	0,18 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	Nomura International PLC	Royaume-Uni	258 478	0,03 %	0,03 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	RBC Europe Ltd	Royaume-Uni	4 927 700	0,58 %	0,58 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	UBS AG	Suisse	603 769	0,07 %	0,07 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	Barclays PLC	Royaume-Uni	5 002 660	1,61 %	1,64 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	BNP Paribas SA	France	1 557 512	0,5 %	0,51 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	706 377	0,23 %	0,23 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	176 534	0,06 %	0,06 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	210 998	0,07 %	0,07 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	825 620	0,27 %	0,27 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	Nomura International PLC	Royaume-Uni	172 319	0,06 %	0,06 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	RBC Europe Ltd	Royaume-Uni	1 423 340	0,46 %	0,47 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	UBS AG	Suisse	387 527	0,12 %	0,13 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	15 114 255	0,75 %	0,77 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	262 970 626	13,12 %	13,33 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	BNP Paribas SA	France	7 424 132	0,37 %	0,38 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	6 151 226	0,31 %	0,31 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	4 378 171	0,22 %	0,22 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	55 264 132	2,76 %	2,8 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	47 632 885	2,38 %	2,42 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	3 656 939	0,18 %	0,19 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	Nomura International PLC	Royaume-Uni	6 255 616	0,31 %	0,32 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	RBC Europe Ltd	Royaume-Uni	14 926 917	0,74 %	0,76 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	UBS AG	Suisse	5 897 931	0,29 %	0,3 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	8 894 782	0,13 %	0,14 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	454 892 456	6,81 %	6,94 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	BNP Paribas SA	France	14 395 034	0,22 %	0,22 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	27 442 139	0,41 %	0,42 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	24 323 916	0,36 %	0,37 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	76 237 887	1,14 %	1,16 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	92 481 894	1,39 %	1,41 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	11 731 859	0,18 %	0,18 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	Nomura International PLC	Royaume-Uni	35 435 739	0,53 %	0,54 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	RBC Europe Ltd	Royaume-Uni	23 923 805	0,36 %	0,36 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	UBS AG	Suisse	10 972 803	0,16 %	0,17 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	411 121 843	1,61 %	1,64 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	BNP Paribas Arbitrage SNC	France	6 338 510	0,02 %	0,03 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	380 070 704	1,49 %	1,52 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	201 062 063	0,79 %	0,8 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	4 008 013	0,02 %	0,02 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	451 230 797	1,77 %	1,8 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	44 358 254	0,17 %	0,18 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	85 349 680	0,33 %	0,34 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	Societe Generale SA	France	170 349 450	0,67 %	0,68 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	UBS AG	Suisse	258 692 707	1,01 %	1,03 %
State Street Switzerland Index Equity Fund	CHF	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	65 715	0,03 %	0,03 %
State Street Switzerland Index Equity Fund	CHF	UBS AG	Suisse	88 599	0,04 %	0,04 %
State Street UK Index Equity Fund	GBP	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	167 415	0,18 %	0,18 %
State Street UK Index Equity Fund	GBP	Societe Generale SA	France	391 649	0,41 %	0,42 %
State Street UK Index Equity Fund	GBP	UBS AG	Suisse	118 132	0,12 %	0,13 %
State Street US Screened Index Equity Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	7 942 720	0,49 %	0,5 %
State Street US Screened Index Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	307 294	0,02 %	0,02 %
State Street US Screened Index Equity Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	175 623	0,01 %	0,01 %
State Street US Screened Index Equity Fund	USD	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	72 431	0 %	0 %
State Street US Screened Index Equity Fund	USD	Societe Generale SA	France	15 192 973	0,95 %	0,95 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street US Screened Index Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	260 225	0,02 %	0,02 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	EUR	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	1 029 969	0,39 %	0,39 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	EUR	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	27 819	0,01 %	0,01 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	EUR	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	679 417	0,25 %	0,26 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	EUR	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	128 097	0,05 %	0,05 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	EUR	Societe Generale SA	France	848 864	0,32 %	0,32 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	EUR	UBS AG	Suisse	1 030 740	0,39 %	0,39 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	1 692 344	0,27 %	0,27 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	BNP Paribas Arbitrage SNC	France	263 491	0,04 %	0,04 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	199 892	0,03 %	0,03 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	139 362	0,02 %	0,02 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	278 066	0,04 %	0,04 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	724 048	0,11 %	0,12 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	149 229	0,02 %	0,02 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	Societe Generale SA	France	846 678	0,13 %	0,13 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	UBS AG	Suisse	5 140 665	0,81 %	0,82 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	169 869	0,25 %	0,26 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	BNP Paribas Arbitrage SNC	France	329 463	0,49 %	0,5 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	22 339	0,03 %	0,03 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	1 875 385	2,81 %	2,83 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	206 308	0,31 %	0,31 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	14 797	0,02 %	0,02 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	291 765	0,44 %	0,44 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	13 088 923	0,28 %	0,28 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	17 458 442	0,37 %	0,38 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	BNP Paribas Arbitrage SNC	France	1 897 742	0,04 %	0,04 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	6 632 383	0,14 %	0,14 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	36 845 032	0,79 %	0,8 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	1 593 961	0,03 %	0,03 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	5 890 983	0,13 %	0,13 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	3 109 177	0,07 %	0,07 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	406 791	0,01 %	0,01 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	Societe Generale SA	France	22 914 135	0,49 %	0,49 %
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	22 352 074	0,48 %	0,48 %
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	9 191 543	0,38 %	0,38 %
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	BNP Paribas Arbitrage SNC	France	990 896	0,04 %	0,04 %
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	3 722 656	0,15 %	0,16 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	19 029 727	0,79 %	0,8 %
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	2 143 919	0,09 %	0,09 %
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	4 050 391	0,17 %	0,17 %
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	3 334 739	0,14 %	0,14 %
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	540 563	0,02 %	0,02 %
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	Societe Generale SA	France	26 878 211	1,12 %	1,13 %
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	13 891 095	0,58 %	0,58 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	804 729	0,13 %	0,13 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	181	0 %	0 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	38 916	0,01 %	0,01 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	1 222 070	0,2 %	0,2 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	827 351	0,13 %	0,13 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	1 071 793	0,17 %	0,17 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	96 805	0,02 %	0,02 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	679 853	0,11 %	0,11 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	Societe Generale SA	France	61 836	0,01 %	0,01 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	519 304	0,08 %	0,08 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	EUR	Barclays PLC	Royaume-Uni	90 543	0,05 %	0,05 %
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	EUR	UBS AG	Suisse	178 724	0,09 %	0,1 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	3 588 737	1,18 %	1,19 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	1 882 930	0,62 %	0,63 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	BNP Paribas Arbitrage SNC	France	212 300	0,07 %	0,07 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	2 812 753	0,93 %	0,94 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	423 410	0,14 %	0,14 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	Macquarie Bank Ltd	Australie	308 970	0,1 %	0,1 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	14 983	0 %	0 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	292 079	0,1 %	0,1 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	EUR	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	1 228 067	0,34 %	0,35 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	EUR	BNP Paribas Arbitrage SNC	France	409 049	0,11 %	0,12 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	EUR	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	28 356	0,01 %	0,01 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	EUR	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	22 844	0,01 %	0,01 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	EUR	Societe Generale SA	France	538 432	0,15 %	0,15 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	EUR	UBS AG	Suisse	2 664 856	0,75 %	0,75 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	1 749 814	0,3 %	0,3 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	460 362	0,08 %	0,08 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	5 189 963	0,89 %	0,9 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	53 441	0,01 %	0,01 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Societe Generale SA	France	7 136 816	1,22 %	1,24 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	205 014	0,03 %	0,04 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	364 308	0,42 %	0,43 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	380 608	0,44 %	0,45 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	375 473	0,43 %	0,44 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Credit Suisse International	Royaume-Uni	139 189	0,16 %	0,16 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	280 944	0,32 %	0,33 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	271 139	0,31 %	0,32 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Macquarie Bank Ltd	Australie	78 542	0,09 %	0,09 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	295 723	0,34 %	0,35 %
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	3 038 271	0,35 %	0,36 %
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	1 656 006	0,19 %	0,2 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	BNP Paribas Arbitrage SNC	France	201 693	0,04 %	0,04 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	4 593	0 %	0 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	974 752	0,17 %	0,18 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	317 422	0,06 %	0,06 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	985 179	0,17 %	0,18 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Macquarie Bank Ltd	Australie	9 696	0 %	0 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	1 554 945	0,28 %	0,28 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	1 357 133	0,24 %	0,25 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	444 812	0,08 %	0,08 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	EUR	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	473 233	1,78 %	1,79 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	EUR	BNP Paribas Arbitrage SNC	France	144 914	0,55 %	0,55 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	EUR	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	473 164	1,78 %	1,79 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	EUR	Macquarie Bank Ltd	Australie	6 699	0,03 %	0,03 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	EUR	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	10 681	0,04 %	0,04 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	EUR	UBS AG	Suisse	561 941	2,12 %	2,13 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	EUR	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	256 562	1,18 %	1,19 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	EUR	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	60 307	0,28 %	0,28 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	EUR	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	166 408	0,76 %	0,77 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	EUR	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	13 297	0,06 %	0,06 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	EUR	Societe Generale SA	France	131 853	0,6 %	0,61 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	EUR	UBS AG	Suisse	484 032	2,22 %	2,25 %
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	324 007	0,14 %	0,14 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	USD	Credit Suisse International	Royaume-Uni	12	0 %	0 %
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	276 779	0,12 %	0,12 %
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	224 344	0,1 %	0,1 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	USD	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	152 980	0,05 %	0,06 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	1 662 854	0,6 %	0,6 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	USD	Credit Suisse International	Royaume-Uni	451 470	0,16 %	0,16 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	615 566	0,22 %	0,22 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	2 324 034	0,83 %	0,84 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	536 196	0,19 %	0,19 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	USD	UBS AG	Suisse	2 703 308	0,97 %	0,98 %
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	USD	Morgan Stanley & Co. International PLC	Royaume-Uni	1 358 656	1,25 %	1,26 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	Barclays Capital Securities Ltd	Royaume-Uni	49 392 162	1,04 %	1,05 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	601 236 588	12,62 %	12,81 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	BNP Paribas SA	France	85 264 725	1,79 %	1,82 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	Citigroup Global Markets Ltd	Royaume-Uni	32 542 575	0,68 %	0,69 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	Goldman Sachs International	Royaume-Uni	9 315 524	0,2 %	0,2 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	HSBC Bank PLC	Royaume-Uni	114 928 565	2,41 %	2,45 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	7 450 030	0,16 %	0,16 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	95 827 193	2,01 %	2,04 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	RBC Europe Ltd	Royaume-Uni	32 524 426	0,68 %	0,69 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	UBS AG	Suisse	13 201 180	0,28 %	0,28 %
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	12 400 796	0,55 %	0,56 %
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	USD	BNP Paribas SA	France	46 070 135	2,03 %	2,1 %
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	21 914 028	0,96 %	1 %
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	EUR	BNP Paribas SA	France	3 484 605	1,26 %	1,28 %
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	EUR	Merrill Lynch International	Royaume-Uni	1 291 447	0,47 %	0,47 %
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	EUR	UBS AG	Suisse	446 820	0,16 %	0,16 %
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	USD	BNP Paribas SA	France	631 899	0,12 %	0,12 %
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	USD	Barclays PLC	Royaume-Uni	1 749 512	0,48 %	0,49 %
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	USD	BNP Paribas SA	France	9 361 800	2,56 %	2,62 %

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Contrepartie	Pays de constitution de la contrepartie	Valeur de marché des titres prêtés au 31 décembre 2023	% du total des actifs nets	% du total des actifs prêtables du Compartiment*
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	USD	JP Morgan Securities PLC	Royaume-Uni	3 866 693	1,06 %	1,08 %

*Le total des actifs prêtables représente la valeur totale des types d'actifs faisant partie du programme de prêt de titres de la SICAV.

Les revenus sur transactions de prêt de titres ainsi que les coûts et les commissions sont comptabilisés au titre de chaque Compartiment respectif, déduction faite des coûts de l'Agent de prêt de titres du Compartiment.

Au 31 décembre 2023, le revenu sur prêts de titres généré par la SICAV se répartit comme suit :

Nom du Compartiment	Devise	Revenu brut sur prêts de titres	Coûts et frais directs et indirects inhérents aux prêts de titres	Revenu net sur prêts de titres
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	EUR	141 743	35 409	106 334
State Street EMU Government Bond Index Fund	EUR	26 857	6 678	20 179
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	EUR	2 765	691	2 074
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	EUR	207 061	51 673	155 388
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	74 827	18 660	56 167
State Street Global Treasury Bond Index Fund	USD	705 019	176 136	528 883
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	1 319 296	329 631	989 665
State Street Canada Index Equity Fund**	CAD	162 740	40 643	122 097
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	20 699 907	5 167 308	15 532 599
State Street Switzerland Index Equity Fund	CHF	473 440	119 604	353 836
State Street UK Index Equity Fund	GBP	728	180	548
State Street US Screened Index Equity Fund	USD	65 610	16 392	49 218
State Street EMU Screened Index Equity Fund	EUR	53 385	13 323	40 062
State Street Europe Screened Index Equity Fund	EUR	306 867	76 673	230 194
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	8 355	2 082	6 273
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	1 415 352	353 646	1 061 706
State Street World ESG Index Equity Fund	USD	592 266	147 887	444 379
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	USD	96 470	24 073	72 397
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	EUR	1 606	401	1 205
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	USD	113 443	28 318	85 125
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	EUR	176 137	44 013	132 124
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	81 768	20 426	61 342
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	23 596	5 856	17 740
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	USD	73 455	18 356	55 099
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	168 864	42 192	126 672
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	EUR	10 017	2 495	7 522

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

10. Prêt de titres (suite)

Nom du Compartiment	Devise	Revenu brut sur prêts de titres	Coûts et frais directs et indirects inhérents aux prêts de titres	Revenu net sur prêts de titres
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	EUR	14 470	3 591	10 879
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	USD	15 716	3 926	11 790
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	USD	171 358	42 805	128 553
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	USD	64 514	16 122	48 392
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	USD	1 353 326	338 220	1 015 106
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	USD	110 993	27 740	83 253
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	USD	488	122	366
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	EUR	15 649	3 904	11 745
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	USD	14 518	3 622	10 896
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	USD	26 426	6 597	19 829

** Ce Compartiment a été liquidé au cours de l'exercice. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

11. Transactions avec des Parties rattachées

State Street Corporation est l'entité mère ultime de la Société de gestion, du Distributeur, des Gestionnaires financiers délégués, du Gestionnaire financier, de l'Agent d'administration centrale, du Dépositaire, de l'Agent payeur principal, de l'Agent de transfert, de l'Agent domiciliataire et de l'Agent de prêt de titres.

Afin de coordonner des opérations sur titres pour la SICAV, les sociétés de State Street Group peuvent avoir assuré la prestation de services de courtage, de change, de banque et autres, ou être intervenues en tant que mandataire à leurs conditions habituelles, et en avoir tiré profit. De telles transactions auront été souscrites dans le cadre des activités ordinaires et sous conditions commerciales normales. Les commissions ont été payées aux courtiers et agents conformément aux pratiques de marché en vigueur et le bénéfice de toute remise de quantité ou autres remises sur commission ou remises en espèces accordées par les courtiers ou agents a été répercuté sur la SICAV.

La Société de gestion et les Gestionnaires financiers auraient pu recourir aux services des sociétés de State Street Group s'ils l'avaient jugé approprié, sous réserve que leurs commissions et autres conditions commerciales applicables soient généralement comparables à celles proposées par des courtiers et agents concurrents sur le marché concerné.

Au cours de l'exercice, il n'y a pas eu de transaction sortant du cadre ordinaire des activités ou contraires aux conditions commerciales normales existantes entre la SICAV, la Société de gestion, le Distributeur, les Gestionnaires financiers délégués, le Gestionnaire financier, l'Agent administratif central, le Dépositaire, l'Agent payeur principal, l'Agent de transfert, l'Agent domiciliataire ou les Administrateurs de la SICAV.

Certains Administrateurs de la SICAV sont ou peuvent également être Cadres dirigeants et/ou Administrateurs de l'une ou plusieurs des entités de State Street Group.

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

12. Commissions indirectes

Aucun accord de commissions indirectes n'a été conclu par la Société de gestion ou le Gestionnaire financier et/ou le Gestionnaire de portefeuille délégué concerné avec des courtiers au cours de l'exercice clôturé le 31 décembre 2023.

13. Événements significatifs

Le Compartiment State Street Canada Index Equity Fund a été liquidé le 14 juin 2023.

Aucun nouveau Compartiment n'a été lancé au cours de l'année 2023.

Un nouveau prospectus a été publié le 30 juin 2023.

Un nouveau Prospectus pour le Fonds a été publié le 1^{er} janvier 2023 et fait état de la reclassification des compartiments suivants, précédemment catégorisés sous l'Article 9, en compartiments relevant de l'Article 8 :

State Street Sustainable Climate US Equity Fund

State Street Sustainable Climate World Equity Fund

State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund

State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund

Le 9 mars 2023, le Nasdaq a retiré de la cote les actions de Silicon Valley Bank Financial Group (ticker : SIVB) à la suite d'ordres de retraits de dépôts et de pertes sur titres, avant que la Silicon Valley Bank soit mise sous tutelle de la Federal Deposit Insurance Corporation (« FDIC »). La SICAV détenait des participations négligeables dans SIVB. La négociation en Bourse de l'action ordinaire de SVB a repris le 28 mars 2023. Le 31 mars 2023, toutes les actions ordinaires SVB ont été liquidées. La cotation de SVB est restée coordonnée tout au long de la période entamée le 9 mars 2023 et continue d'être valorisée suivant les cours du marché.

Le 13 mars 2023, le Nasdaq a suspendu la négociation des actions de Signature Bank of New York (ticker : SBNY) avant que Signature Bank of New York soit mise sous tutelle de la FDIC. La SICAV détenait des participations négligeables dans SBNY. La négociation en Bourse de l'action ordinaire de Signature Bank a repris le 28 mars 2023. Le 31 mars 2023, toutes les actions ordinaires SBNY ont été liquidées. La cotation des obligations de Signature Bank est restée coordonnée tout au long de la période entamée le 9 mars 2023 et continue d'être valorisée suivant les cours du marché.

Le 19 mars 2023, Credit Suisse et UBS ont annoncé avoir conclu un accord de fusion à la suite de l'intervention du Département fédéral des finances, de la Banque nationale suisse et de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers (« FINMA »). L'entité survivante après clôture de l'opération de fusion sera UBS. Il a été annoncé que la FINMA avait décidé que la valeur des obligations AT1 émises par Crédit Suisse serait ramenée à zéro. La SICAV ne détenait pas d'obligations AT1 et n'avait pas d'avoirs significatifs en titres affiliés à Crédit Suisse.

Conflit israélo-palestinien

Le Comité de valorisation européen et la fonction de gestion des risques d'entreprise ont examiné les risques liés au déclenchement récent du conflit en Israël (qui, en l'occurrence n'ont pas été jugés importants) et continuent de suivre la situation. Il n'y a eu aucun impact sur la distribution ou les investisseurs et aucune répercussion sur les marchés mondiaux.

Les catégories d'actions suivantes ont été lancées au cours de l'exercice financier :

Nom du Compartiment	Devise de référence du Compartiment	Catégorie d'Actions/Devise	Date de lancement
State Street Sustainable Climate World Equity Fund	GBP	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	3 janvier 2023
State Street World Screened Index Equity Fund	GBP	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	3 janvier 2023

Notes aux États financiers

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 (suite)

13. Événements significatifs (suite)

Nom du Compartiment	Devise de référence du Compartiment	Catégorie d'Actions/Devise	Date de lancement
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	USD	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	27 mars 2023
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	GBP	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	26 avril 2023
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	GBP	Catégorie B Distribution (GBP)	27 avril 2023
State Street Japan Screened Index Equity Fund	GBP	Catégorie B Distribution (GBP)	27 avril 2023
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	GBP	Catégorie B Distribution (GBP)	27 avril 2023
State Street World Screened Index Equity Fund	GBP	Catégorie B Distribution (GBP)	28 avril 2023
State Street World Screened Index Equity Fund	USD	Catégorie I Distribution (USD)	11 juillet 2023
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	CHF	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	15 décembre 2023
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	USD	Catégorie I (USD)	15 décembre 2023

Les catégories d'actions suivantes ont été fermées au cours de l'exercice financier :

Nom du Compartiment	Devise de référence du Compartiment	Catégorie d'actions/Devise	Date de clôture
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	USD	Catégorie B (USD)	3 avril 2023
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	USD	Catégorie B (USD)	4 avril 2023
State Street Global Opportunities Equity Fund	USD	Catégorie B (USD)	4 avril 2023
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	EUR	Catégorie A2 (EUR)	15 mai 2023
State Street Canada Index Equity Fund	CAD	Catégorie I (CAD)	14 juin 2023
State Street Canada Index Equity Fund	CAD	Catégorie I (EUR)	14 juin 2023
State Street Canada Index Equity Fund	CAD	Catégorie P (CAD)	14 juin 2023
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	USD	Catégorie P (USD)	2 octobre 2023
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	USD	Catégorie I (EUR)	27 octobre 2023
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	EUR	Catégorie P (EUR)	1 décembre 2023
State Street Japan Screened Index Equity Fund	JPY	Catégorie B (JPY)	20 décembre 2023
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	USD	Catégorie B (USD)	20 décembre 2023

14. Événements postérieurs à l'arrêté des comptes

Le nouveau prospectus de Luxembourg SICAV a été publié le 14 février 2024.

15. Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (« SFDR »)

Les informations concernant les caractéristiques environnementales et/ou sociales et/ou les investissements durables sont consultables sous la Section non audité consacrée au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et les annexes correspondantes, le cas échéant.

Annexe I – Informations relatives à la divulgation des risques (non auditées) pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

La SICAV calcule l'Exposition globale des Compartiments à l'aide de l'Approche par les engagements

Annexe II – Écart de suivi indiciel (non audité)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Compartiment	Indice répliqué	Écart de performance, brut de commissions (%)	Niveau d'écart de suivi anticipé (%)	Niveau d'écart de suivi réalisé (%)	Remarques
State Street Switzerland Index Equity Fund	MSCI Switzerland	0,11	1,00	0,07	L'écart de performance résulte principalement de l'avantage fiscal du Compartiment par rapport à l'Indice et d'une combinaison d'autres petits facteurs tels que les liquidités non investies, la sélection des titres et la capitalisation.
State Street EMU Screened Index Equity Fund	MSCI EMU EX UNGC AND CW INDEX	0,61	1,00	0,2	L'écart de performance résulte principalement de l'avantage fiscal du Compartiment par rapport à l'Indice et d'une combinaison d'autres petits facteurs tels que les liquidités non investies, la sélection des titres et la capitalisation.
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	MSCI PACIFIC EX JAPAN EX UNGC AND CW INDEX	0,17	1,00	0,06	Le Compartiment a légèrement surperformé l'Indice de référence MSCI en raison d'avantages fiscaux et de petits facteurs tels que les liquidités non investies et la sélection de titres.
State Street Europe Screened Index Equity Fund	MSCI EUROPE EX UNGC AND CW INDEX	0,36	1,00	0,14	L'écart de performance résulte principalement de l'avantage fiscal du Compartiment par rapport à l'Indice et d'une combinaison d'autres petits facteurs tels que les liquidités non investies, la sélection des titres et la capitalisation.
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	BLOOMBERG EURO-AGGREGATE : CORPORATES	0,25	1,00	0,08	Le Compartiment a bénéficié de l'efficacité des techniques d'échantillonnage et de négociation grâce à une série de rachats tout au long de l'exercice. Le Compartiment a surperformé son indice de 25 pb du fait de la sélection de titres établie à partir de la méthode d'échantillonnage utilisée.
State Street World Screened Index Equity Fund	MSCI WORLD EX UNGC AND CW INDEX	0,15	1,00	0,05	L'écart de performance résulte principalement des avantages fiscaux, mais aussi de l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les décalages entre les pondérations de titres et la capitalisation.
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index	-0,09	1,00	0,05	La forte volatilité s'est poursuivie sur les marchés financiers en 2023, ce qui s'est traduit par un écart de performance quelque peu élargi pour les Compartiments. Néanmoins, la performance du Compartiment est restée conforme aux attentes pour ce type de stratégie.
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Bloomberg Global Treasury 40% Germany 40% France 20% Netherlands Custom Index	0,02	1,00	0,01	s/o

Annexe II - Écart de suivi indiciel (non audité) (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Compartiment	Indice répliqué	Écart de performance, brut de commissions (%)	Niveau d'écart de suivi anticipé (%)	Niveau d'écart de suivi réalisé (%)	Remarques
State Street SRI Euro Corporate Bond Fund	Markit iBoxx Euro Index Sustainable Corporate Bond Custom Index	0,28	1,00	0,08	Le Compartiment a bénéficié de l'efficacité des techniques d'échantillonnage et de négociation grâce à une série de rachats tout au long de l'exercice. Le Compartiment a surperformé son indice de 28 pb du fait de la sélection de titres établie à partir de la méthode d'échantillonnage utilisée.
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Bloomberg Global Treasury Index	-0,03	1,00	0,04	s/o
State Street EMU Government Bond Index Fund	FTSE EMU Government Bond Index	0,28	1,00	0,09	Au cours de l'exercice, le Compartiment a enregistré quelques rachats, qui ont été négociés à un prix supérieur à la valorisation. Les gains qui en ont résulté ont été conservés par le Compartiment sur la base de la méthodologie <i>swing pricing</i> , ce qui a entraîné un écart de performance positif à sa faveur.
State Street Euro Inflation Linked Bond Fund	Bloomberg Barclays Eurozone All Consumer Index Price Index (CPI) Inflation-Linked Bond Index	0,09	1,00	0,09	Au cours de l'exercice, le Compartiment a enregistré quelques rachats, qui ont été négociés à un prix supérieur à la valorisation. Les gains qui en ont résulté ont été conservés par le Compartiment sur la base de la méthodologie <i>swing pricing</i> , ce qui a entraîné un écart de performance positif à sa faveur.
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	MSCI EM (EMERGING MARKETS) EX UNGC AND CW INDEX	0,14	1,00	0,13	L'écart de performance résulte de l'effet combiné d'autres petits facteurs, tels que les décalages entre les pondérations de titres, la fiscalité et les frais de transaction.
State Street World ESG Index Equity Fund	MSCI World ESG Universal Index	0,18	1,00	0,05	L'écart de performance est attribuable à l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les décalages entre les pondérations de titres, la capitalisation et les avantages fiscaux.
State Street UK Index Equity Fund	MSCI United Kingdom	-0,05	1,00	0,07	L'écart de performance résulte principalement de l'effet combiné de quelques facteurs : effet des contrats à terme standardisés, effet de change, décalages entre les pondérations de titres, retenue à la source et frais de transaction.
State Street US Screened Index Equity Fund	MSCI USA EX UNGC AND CW INDEX	0,11	1,00	0,05	L'écart de performance résulte de l'effet combiné de petits facteurs, tels que les liquidités non investies, la sélection des titres, la fiscalité et la capitalisation.
State Street Japan Screened Index Equity Fund	MSCI JAPAN EX UNGC AND CW INDEX	0,14	1,00	0,09	L'écart de performance tient à l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les décalages entre les pondérations de titres, le revenu obtenu du prêt des titres, la capitalisation et les avantages fiscaux.

Annexe II - Écart de suivi indiciel (non audité) (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Compartiment	Indice répliqué	Écart de performance, brut de commissions (%)	Niveau d'écart de suivi anticipé (%)	Niveau d'écart de suivi réalisé (%)	Remarques
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	J.P. Morgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified	0,19	1,00	0,23	Les contributions sont principalement attribuables aux plus-values générées par l'allocation d'actifs du fait d'une légère sous-pondération des obligations russes. Légère perte sur l'allocation en devises, imputable à la compensation de la surpondération du RUB (via des contrats de change à terme) pour neutraliser le risque lié à la sous-pondération des obligations russes.
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Bloomberg Global Treasury Index	-0,02	1,00	0,03	s/o
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	J.P. Morgan ESG-Government Bond Index Emerging Markets Global Diversified	0,14	1,00	0,16	La surperformance provient principalement de la sélection de titres, de l'exposition aux contrats à terme sur l'EGP et des plus-values intrajournalières.
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	ICE BoFA Global High Yield Constrained Index	0,40	1,00	0,23	Le Compartiment est de petite taille au regard de son exposition sous-jacente. En outre, le portefeuille a beaucoup recours à l'échantillonnage en raison des filtres ESG POV (preuve de valeur), ce qui génère des sous-pondérations importantes de certains émetteurs qui doivent être compensées par une série de petites surpondérations à l'extrémité supérieure de l'échelle de mesure du risque des équipes FI Beta.
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified index	0,20	1,00	0,29	La surperformance provient principalement de la sélection de titres. Les actifs sous gestion de ce Compartiment ont augmenté en 2023, même s'ils sont restés relativement limités au cours de la période. C'est pourquoi le Compartiment a eu recours à l'échantillonnage.
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index	s/o	1,00	s/o	Année non complète

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Le prospectus, les informations clés pour l'investisseur, les statuts, les rapports annuels et semestriels de STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV, ainsi que la liste des achats et ventes effectués par STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV pendant la période peuvent être obtenus sur simple demande et gratuitement au siège du Représentant et Service de paiement en Suisse, State Street Bank International GmbH, Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, Postfach, CH-8027 Zurich.

Pour les actions distribuées en Suisse ou depuis la Suisse, State Street Fondsleitung AG, Beethovenstrasse 19, Postfach, 8027 Zurich, Suisse, est le Représentant en Suisse, tandis que State Street Bank GmbH, Munchen, Zweigniederlassung Zurich, Beethovenstrasse 19, 8027 Zurich, Suisse, est l'Agent Payeur en Suisse.

Le lieu d'exécution et la compétence juridique pour les actions vendues en Suisse et depuis la Suisse sont sis au siège social du Représentant en Suisse.

Le Prospectus, le Document d'information clé pour l'investisseur (DICI), les Statuts et les rapports annuel et semestriel ainsi que la liste des acquisitions et des cessions réalisées durant l'exercice peuvent être obtenus gratuitement auprès du Représentant en Suisse.

Les informations publiées sont fournies uniquement à titre informatif. Elles ne constituent pas une offre de souscription ou de rachat des Actions au prix de souscription ou de rachat publié ou à la Valeur nette d'inventaire par Action publiée.

Les paiements/compensations (commissions de suivi) sont prélevés sur la commission de gestion aux fins de la distribution/commercialisation du fonds d'investissement et versés aux distributeurs et gérants d'actifs. Les remboursements sont accordés sur la commission de gestion aux investisseurs institutionnels et sont calculés conformément aux directives de la SFAMA.

Total des frais sur encours (TER)

En Suisse, le « total des frais sur encours » (TER pour *Total Expense Ratio*) calculé en tenant compte des exigences en vigueur en Suisse est présenté et expliqué dans les rapports annuel et semestriel ainsi que dans le DICI. Le mode de calcul du TER et de la performance du Compartiment dans ces documents correspond à la méthode recommandée par la Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA) et se calcule donc selon la formule suivante :

$$\text{TER \%} = \frac{\text{Total des dépenses d'exploitation en UM}^*}{\text{Moyenne des actifs du Compartiment en UM}^*}$$

* UM = Unités de monnaie dans la monnaie de compte du Compartiment

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	0,05 %
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,20 %
	Catégorie P (EUR)	0,35 %
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	(0,19 %)
	Catégorie I (EUR)	0,02 %
	Catégorie P (EUR)	0,11 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	0,11 %
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	0,25 %
	Catégorie P (EUR)**	s/o
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie B (EUR)	0,04 %
	Catégorie I (EUR)	0,19 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,19 %
	Catégorie P (EUR)	0,34 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	0,34 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	0,26 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,26 %
	Catégorie S (EUR)	0,11 %
	Catégorie A2 (EUR)**	s/o
	Catégorie A2 Distribution (EUR)	0,13 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Total des frais sur encours (TER) (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	0,05 %
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,05 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,23 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,23 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	0,23 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SGD)	0,23 %
	Catégorie I (USD)	0,20 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	0,23 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,23 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,23 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie P (USD)	0,35 %
	Catégorie B (Portefeuille couvert en GBP)	0,03 %
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,03 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,21 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,21 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	0,21 %
	Catégorie I (USD)	0,18 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)*	0,21 %
Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,21 %	
State Street Canada Index Equity Fund	Catégorie I (CAD)**	s/o
	Catégorie I (EUR)**	s/o
	Catégorie P (CAD)**	s/o
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B (JPY)**	s/o
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,30 %
	Catégorie I (JPY)	0,30 %
	Catégorie P (JPY)	0,70 %
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie A (CHF)	0,40 %
	Catégorie I (CHF)	0,30 %
	Catégorie P (CHF)	0,70 %
	Catégorie P (EUR)	0,69 %
	Catégorie S (CHF)	0,17 %
State Street UK Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	0,30 %
	Catégorie I (GBP)	0,30 %
	Catégorie P (GBP)	0,70 %
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	0,04 %
	Catégorie B Distribution (GBP)	0,04 %
	Catégorie I (VNI couverte en EUR)	0,26 %
	Catégorie I (EUR)	0,24 %
	Catégorie I (USD)	0,24 %
	Catégorie P (USD)	0,64 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie A (EUR)	0,40 %
	Catégorie B (EUR)	0,06 %
	Catégorie I (EUR)	0,26 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,26 %
	Catégorie P (EUR)	0,70 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Total des frais sur encours (TER) (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie B (EUR)	0,05 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,05 %
	Catégorie I (EUR)	0,25 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,25 %
	Catégorie P (EUR)	0,67 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	(0,86 %)
	Catégorie B (USD)**	s/o
	Catégorie I (EUR)	0,18 %
	Catégorie I (USD)	0,17 %
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie P (USD)	0,56 %
	Catégorie B (Distribution couverte en GBP)*	0,04 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,03 %
	Catégorie B (USD)	0,04 %
	Catégorie B (Portefeuille couvert en USD)	0,04 %
	Catégorie I (EUR)	0,24 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,27 %
	Catégorie I (GBP)	0,24 %
	Catégorie I (SEK)	0,23 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SEK)	0,27 %
	Catégorie I (USD)	0,24 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en CHF)	0,27 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,27 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,27 %
	Catégorie I Distribution (USD)*	0,22 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,27 %
	Catégorie P (Portefeuille couvert en EUR)	0,67 %
	Catégorie P (SEK)	0,63 %
	Catégorie P (Portefeuille couvert en SEK)	0,67 %
	Catégorie P (USD)	0,64 %
Catégorie S (USD)	0,10 %	
Catégorie S Distribution (USD)	0,10 %	
State Street World ESG Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	0,05 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,29 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,25 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,09 %
	Catégorie B (USD)	0,10 %
	Catégorie I (GBP)	0,40 %
	Catégorie I (SEK)	0,40 %
	Catégorie I (USD)	0,40 %
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	Catégorie P (USD)	1,35 %
	Catégorie B (EUR)	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,65 %
State Street Europe Value Spotlight Fund	Catégorie P (EUR)	1,24 %
	Catégorie B (EUR)	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,85 %
	Catégorie P (EUR)	1,64 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Total des frais sur encours (TER) (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,85 %
	Catégorie P (EUR)	1,64 %
State Street US Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	0,10 %
	Catégorie I (USD)	0,85 %
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	0,10 %
	Catégorie I (USD)	0,85 %
State Street Global Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	0,10 %
	Catégorie I (EUR)	0,85 %
	Catégorie I (USD)	0,85 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund	Catégorie P (EUR)	1,64 %
	Catégorie B (USD)	0,07 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,10 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,45 %
	Catégorie I (EUR)	0,38 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie P (EUR)	0,40 %
	Catégorie I (USD)	0,36 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie P (USD)	(0,44 %)
	Catégorie I (USD)	0,45 %
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	Catégorie I Distribution (USD)	0,45 %
	Catégorie I (EUR)	0,55 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,55 %
	Catégorie B (GBP)	0,06 %
	Catégorie B (USD)**	s/o
	Catégorie I (EUR)	0,57 %
	Catégorie I (USD)	0,52 %
	Catégorie P (EUR)	1,06 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie P (USD)	1,11 %
	Catégorie I (EUR)	0,60 %
	Catégorie P (EUR)	1,64 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	1,64 %
	Catégorie P (EUR)	1,64 %
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P Distribution (EUR)	1,64 %
	Catégorie A (USD)	1,48 %
	Catégorie I (EUR)	1,35 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie I (USD)	1,34 %
	Catégorie P (USD)	2,48 %
	Catégorie A (USD)	0,56 %
	Catégorie B (USD)	0,09 %
	Catégorie I (EUR)	0,43 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,46 %
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,43 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,43 %
	Catégorie P (USD)	1,03 %
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	Catégorie B (EUR)	0,10 %
	Catégorie B (USD)**	s/o
	Catégorie I (USD)	0,85 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Total des frais sur encours (TER) (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,12 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,13 %
	Catégorie I (USD)	0,11 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	0,13 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	0,13 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,13 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	0,13 %
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	0,00 %
	Catégorie I (USD)	0,15 %
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	Catégorie I (EUR)**	s/o
	Catégorie I (USD)	0,43 %
	Catégorie P (EUR)	1,09 %
	Catégorie P (USD)	1,05 %
State Street Global Opportunities Equity Fund	Catégorie B (USD)**	s/o
	Catégorie I (USD)	0,60 %
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	Catégorie I (USD)	0,20 %
	Catégorie I (couverte en EUR)	0,26 %
	Catégorie P (USD)**	s/o
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie S (USD)	0,13 %
	Catégorie B (EUR)	(0,02 %)
	Catégorie I (EUR)	0,20 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	0,23 %
	Catégorie P (EUR)	0,49 %
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie S (EUR)	0,12 %
	Catégorie B (Portefeuille couvert en EUR)	0,11 %
	Catégorie B (USD)	0,10 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	0,29 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	0,29 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en NOK)	0,29 %
	Catégorie I (USD)	0,25 %
Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	0,29 %	
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	0,28 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	0,11 %
	Catégorie B (USD)	0,09 %
	Catégorie I (EUR)	0,24 %
	Catégorie I (USD)	0,26 %
State Street US Opportunities Equity Fund	Catégorie I Distribution (USD)	0,24 %
	Catégorie I (USD)	0,60 %
State Street China Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	(0,51 %)
State Street Sustainable Climate World Equity Fund	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,11 %
	Catégorie I (USD)	0,38 %
State Street Sustainable Climate US Equity Fund	Catégorie I (USD)	0,40 %
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	0,10 %
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	0,04 %
	Catégorie I (USD)	0,20 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Total des frais sur encours (TER) (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	TER au 31 décembre 2023
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)*	0,30 %
	Catégorie I (USD)*	0,27 %

* Cette catégorie d'actions a été lancée durant l'exercice clôturé le 31 décembre 2023. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

** Cette catégorie d'actions a été fermée durant l'exercice clôturé le 31 décembre 2023. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Performance

La performance de chaque Catégorie d'actions correspond à la variation de la valeur nette d'inventaire durant la période d'observation concernée, déduction faite des distributions brutes exprimées dans la devise de la Catégorie d'actions dans le cas des Catégories d'actions de distribution.

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	VNI au 31 déc. 22	VNI au 31 déc. 23	Performance 2021	Performance 2022	Performance 2023
State Street Global Aggregate Bond Index Fund	Catégorie B (Portefeuille couvert en GBP)	9,72	10,31	-1,60 %	-12,05 %	5,97 %
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	9,96	10,58	s/o	s/o	6,03 %
	Catégorie I (USD)	9,69	10,23	-4,92 %	-16,30 %	5,42 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	9,42	9,63	-2,70 %	-13,66 %	2,09 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	9,86	10,29	-2,41 %	-13,25 %	4,29 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	10,44	11,05	-1,78 %	-12,24 %	5,78 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	11,28	12,06	-1,57 %	-11,34 %	6,76 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)*	s/o	10,40	s/o	s/o	8,10 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	s/o	11,00	s/o	s/o	2,26 %
	Catégorie I (EUR)	14,21	16,48	12,73 %	-11,45 %	-7,19 %
	Catégorie I (JPY)	14,82	19,00	4,77 %	-4,78 %	1,60 %
	Catégorie P (JPY)	14,40	18,39	4,35 %	-5,15 %	3,55 %
State Street Switzerland Index Equity Fund	Catégorie A (CHF)	9,18	9,63	s/o	s/o	0,15 %
	Catégorie I (CHF)	14,53	15,27	22,55 %	-17,23 %	11,14 %
	Catégorie P (EUR)	15,61	17,34	27,41 %	-13,5 %	4,64 %
	Catégorie P (CHF)	14,12	14,77	22,06 %	-17,56 %	5,18 %
	Catégorie S (CHF)	12,99	13,66	22,71 %	-17,13 %	7,28 %
State Street UK Index Equity Fund	Catégorie I (GBP)	15,82	16,98	19,24 %	6,86 %	9,85 %
	Catégorie I (EUR)	13,14	14,43	27,12 %	1,13 %	6,86 %
	Catégorie P (GBP)	15,38	16,43	18,76 %	6,44 %	26,74 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Performance (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	VNI au 31 déc. 22	VNI au 31 déc. 23	Performance 2021	Performance 2022	Performance 2023
State Street US Screened Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	21,61	27,38	26,78 %	-20,12 %	19,58 %
	Catégorie B Distribution (GBP)	9,99	11,95	s/o	s/o	26,48 %
	Catégorie I (USD)	21,29	26,93	26,53 %	-20,28 %	22,24 %
	Catégorie I (EUR)	22,29	27,25	36,14 %	-15,05 %	23,07 %
	Catégorie I (VNI couverte en EUR)	18,24	22,44	25,41 %	-22,77 %	25,98 %
	Catégorie P (USD)	20,68	26,06	22,36 %	-20,60 %	19,09 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie A (EUR)	10,65	12,68	s/o	-12,58 %	19,50 %
	Catégorie B (EUR)	14,95	17,87	23,13 %	-12,28 %	19,26 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie I (EUR)	14,73	17,57	22,88 %	-12,46 %	19,26 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund	Catégorie I Distribution (EUR)	10,91	12,71	22,88 %	-12,46 %	18,73 %
	Catégorie P (EUR)	14,29	16,97	22,36 %	-12,84 %	16,35 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund	Catégorie B (EUR)	13,90	16,17	25,31 %	-10,32 %	13,64 %
	Catégorie B Distribution (GBP)	9,88	11,23	s/o	s/o	16,12 %
	Catégorie I (EUR)	14,52	16,86	25,06 %	-10,48 %	16,12 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	12,62	14,29	25,06 %	-10,50 %	15,63 %
	Catégorie P (EUR)	14,09	16,30	24,54 %	-10,88 %	3,14 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	s/o	10,10	s/o	s/o	-7,19 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index equity Fund	Catégorie I (USD)	15,62	16,43	4,77 %	-8,41 %	1,60 %
	Catégorie I (EUR)	12,70	12,92	12,73 %	-2,41 %	3,55 %
	Catégorie P (USD)	15,17	15,90	21,37 %	-8,77 %	0,15 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Performance (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	VNI au 31 déc. 22	VNI au 31 déc. 23	Performance 2021	Performance 2022	Performance 2023
State Street World Screened Index Equity Fund	Catégorie B (Distribution couverte en GBP)*	s/o	12,27	s/o	s/o	24,08 %
	Catégorie B Distribution (GBP)*	s/o	11,15	s/o	s/o	24,58 %
	Catégorie B (USD)	18,58	23,06	22,11 %	-18,54 %	21,04 %
	Catégorie B (Portefeuille couvert en USD)	18,28	22,78	24,66 %	-15,81 %	23,83 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	10,12	12,23	s/o	s/o	19,63 %
	Catégorie I (USD)	18,30	22,67	21,87 %	-18,74 %	21,10 %
	Catégorie I (EUR)	19,17	22,94	31,12 %	-13,36 %	16,85 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	12,03	14,57	22,75 %	-18,42 %	24,26 %
	Catégorie I (GBP)	14,74	17,23	22,99 %	-8,44 %	18,50 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	8,97	11,00	s/o	-16,02 %	22,62 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en CHF)	8,60	10,07	s/o	-18,86 %	20,77 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	8,79	10,63	s/o	-17,76 %	23,34 %
	Catégorie I Distribution (USD)*	s/o	10,87	s/o	s/o	20,58 %
	Catégorie I (SEK)	101,21	121,27	s/o	-6,42 %	23,75 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SEK)	91,99	111,13	s/o	-18,79 %	20,29 %
	Catégorie P (USD)	17,77	21,93	21,37 %	-19,02 %	24,00 %
	Catégorie P (Portefeuille couvert en EUR)	16,36	19,73	22,75 %	-18,71 %	24,00 %
	Catégorie P (Portefeuille couvert en SEK)	86,64	104,26	s/o	-19,04 %	19,77 %
	Catégorie P (SEK)	103,78	123,85	s/o	-6,82 %	20,87 %
	Catégorie S (USD)	12,17	15,10	22,03 %	-18,58 %	19,30 %
Catégorie S Distribution (USD)	11,94	14,58	22,03 %	-18,58 %	24,00 %	
State Street World ESG Index Equity Fund	Catégorie B (USD)	19,75	24,49	22,97 %	-18,66 %	9,51 %
	Catégorie I (USD)	18,54	22,95	22,70 %	-18,82 %	3,33 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	11,95	14,45	24,51 %	-18,18 %	6,10 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund	Catégorie B Distribution (GBP)*	s/o	10,51	s/o	s/o	8,47 %
	Catégorie B (USD)	14,30	15,74	-2,57 %	-20,97 %	11,94 %
	Catégorie I (USD)	13,99	15,35	-2,86 %	-21,21 %	11,32 %
	Catégorie I (GBP)	9,00	9,32	-1,96 %	-11,28 %	10,67 %
	Catégorie I (SEK)	89,13	94,57	s/o	-9,32 %	21,10 %
Catégorie P (USD)	13,08	14,21	-3,78 %	-21,95 %	20,13 %	
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund	Catégorie B (EUR)	11,63	13,02	13,30 %	-10,70 %	19,16 %
	Catégorie I (EUR)	11,11	12,37	12,68 %	-11,19 %	26,22 %
	Catégorie P (EUR)	10,67	11,80	12,02 %	-11,71 %	25,27 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Performance (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	VNI au 31 déc. 22	VNI au 31 déc. 23	Performance 2021	Performance 2022	Performance 2023
State Street Europe Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	15,91	19,27	16,22 %	-2,92 %	24,29 %
	Catégorie I (EUR)	10,97	13,17	15,34 %	-3,65 %	12,38 %
	Catégorie P (EUR)	13,72	16,35	14,46 %	-4,40 %	15,44 %
State Street Eurozone Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	18,53	23,38	21,71 %	-4,40 %	11,01 %
	Catégorie I (EUR)	15,55	19,47	20,79 %	-4,85 %	14,04 %
	Catégorie P (EUR)	15,49	19,25	19,77 %	-5,86 %	10,32 %
State Street US Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	19,57	21,99	37,29 %	4,08 %	9,50 %
	Catégorie I (USD)	16,06	18,54	26,65 %	-3,06 %	13,32 %
State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	17,96	19,93	-2,16 %	1,53 %	8,63 %
	Catégorie I (USD)	14,91	17,00	-5,75 %	-5,42 %	19,00 %
State Street Global Value Spotlight Fund	Catégorie B (EUR)	24,18	26,67	15,61 %	-0,71 %	12,30 %
	Catégorie I (EUR)	19,67	21,53	14,73 %	-1,67 %	18,57 %
	Catégorie I (USD)	8,82	10,00	s/o	-7,51 %	16,15 %
	Catégorie P (EUR)	18,79	20,41	13,85 %	-2,23 %	15,88 %
State Street Multi- Factor Global ESG Equity Fund	Catégorie B (USD)	13,49	16,06	23,88 %	-18,92 %	24,53 %
	Catégorie B Distribution (GBP)	9,97	11,20	s/o	s/o	24,24 %
	Catégorie I (USD)	14,61	17,33	23,44 %	-19,25 %	23,73 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (EUR)	14,38	16,70	26,43 %	-10,04 %	23,72 %
	Catégorie P (EUR)	12,50	14,48	26,13 %	-10,25 %	11,34 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	19,28	24,01	29,31 %	-18,60 %	7,57 %
	Catégorie P (USD)	18,92	23,51	29,01 %	-18,78 %	8,16 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	16,83	20,84	23,86 %	-17,53 %	8,16 %
	Catégorie I Distribution (USD)	15,12	18,46	23,87 %	-17,54 %	8,32 %
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund	Catégorie I (USD)	12,40	13,81	0,67 %	-20,81 %	-3,04 %
	Catégorie I (EUR)	10,30	11,08	8,32 %	-15,62 %	8,31 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	11,85	12,82	-1,33 %	-13,92 %	-7,19 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	10,23	10,97	-1,33 %	-13,93 %	7,53 %
	Catégorie S (EUR)	8,53	9,24	-1,19 %	-13,78 %	13,43 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund	Catégorie A2 Distribution (EUR)	9,11	9,77	-1,18 %	-13,79 %	12,82 %
	Catégorie B (GBP)	10,55	11,34	2,35 %	-9,98 %	18,06 %
	Catégorie I (USD)	14,19	16,09	0,96 %	-20,42 %	16,85 %
	Catégorie I (EUR)	14,63	16,04	8,62 %	-15,20 %	16,85 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie P (USD)	13,51	15,24	0,41 %	-20,84 %	11,47 %
	Catégorie P (EUR)	10,69	11,65	8,04 %	-15,65 %	11,47 %
	Catégorie I (EUR)	31,43	37,11	26,40 %	-13,78 %	31,39 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund	Catégorie P (EUR)	12,05	14,08	25,09 %	-14,65 %	31,58 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	11,62	13,34	25,10 %	-14,65 %	27,12 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Performance (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	VNI au 31 déc. 22	VNI au 31 déc. 23	Performance 2021	Performance 2022	Performance 2023
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie P (EUR)	12,98	14,47	31,97 %	-17,70 %	30,09 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	11,14	12,07	31,97 %	-17,70 %	3,86 %
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund	Catégorie A (USD)	12,15	15,96	21,63 %	-15,63 %	1,51 %
	Catégorie I (USD)	15,14	19,92	21,80 %	-15,53 %	3,68 %
	Catégorie I (EUR)	12,79	16,26	31,05 %	-9,99 %	3,71 %
	Catégorie P (USD)	11,80	15,34	20,42 %	-16,46 %	5,12 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund	Catégorie I (USD)	8,85	9,20	-1,22 %	-12,36 %	5,86 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	8,96	9,10	-2,30 %	-8,31 %	5,90 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	9,07	9,40	-2,04 %	-7,92 %	12,83 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR)	8,97	9,23	-2,07 %	-7,94 %	6,46 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	9,28	9,68	-1,38 %	-6,65 %	12,66 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	9,54	10,10	-1,22 %	-5,95 %	8,84 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en USD)	9,47	9,95	-1,16 %	-5,91 %	12,66 %
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B Distribution (GBP)	10,01	10,67	s/o	s/o	2,26 %
	Catégorie B (USD)	8,52	9,62	s/o	-11,43 %	9,06 %
	Catégorie I Distribution (USD)	7,86	8,45	s/o	-11,55 %	4,71 %
	Catégorie I (EUR)	8,86	9,66	-2,16 %	-5,77 %	8,44 %
	Catégorie I (USD)	8,63	9,73	-9,07 %	-11,56 %	1,60 %
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	9,71	10,59	-6,08 %	-22,9 %	-14,39 %
	Catégorie P (USD)	7,60	8,24	s/o	-23,38 %	5,56 %
	Catégorie P (EUR)	8,06	8,44	s/o	-18,36 %	8,33 %
State Street Global Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	11,04	14,60	19,15 %	-21,82 %	8,39 %
State Street China Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	7,59	6,50	s/o	s/o	27,29 %
State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund	Catégorie I (VNI couverte en EUR)	8,21	8,67	s/o	-17,94 %	8,31 %
	Catégorie I (USD)	8,64	9,36	s/o	-15,72 %	8,10 %
	Catégorie S (USD)	8,65	9,38	s/o	-15,67 %	8,15 %
State Street US Opportunities Equity Fund	Catégorie I (USD)	8,34	10,61	s/o	s/o	7,79 %
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund	Catégorie B (EUR)	9,04	9,79	s/o	s/o	10,65 %
	Catégorie I (EUR)	8,59	9,28	s/o	-14,13 %	13,69 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	9,05	9,73	s/o	s/o	13,52 %
	Catégorie S (EUR)	8,60	9,30	s/o	-14,08 %	10,45 %
	Catégorie P (EUR)	8,52	9,18	s/o	-14,33 %	8,15 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Performance (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	VNI au 31 déc. 22	VNI au 31 déc. 23	Performance 2021	Performance 2022	Performance 2023
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund	Catégorie B (Portfeuille couvert en EUR)	8,64	9,56	s/o	-13,63 %	13,02 %
	Catégorie B (USD)	8,70	9,89	s/o	-13,25 %	12,07 %
	Catégorie I (USD)	8,58	9,74	s/o	-13,99 %	10,93 %
	Catégorie I (Portfeuille couvert en EUR)	8,61	9,51	s/o	-13,75 %	14,18 %
	Catégorie I (Portfeuille couvert en CHF)	8,58	9,28	s/o	-13,99 %	14,01 %
	Catégorie I (Portfeuille couvert en USD)	8,88	10,04	s/o	-11,60 %	11,10 %
	Catégorie I Distribution (Portfeuille couvert en GBP)	8,48	8,98	s/o	-12,82 %	11,21 %
	Catégorie I (Portfeuille couvert en NOK)	87,70	97,29	s/o	s/o	6,07 %
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	10,08	11,51	s/o	s/o	5,91 %
	Catégorie I (USD)	8,90	10,15	s/o	-11,67 %	5,91 %
State Street Emerging Markets Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	10,97	12,26	s/o	s/o	5,76 %
	Catégorie B Distribution (Portfeuille couvert en GBP)*	s/o	10,80	s/o	s/o	7,40 %
	Catégorie I (USD)	10,97	12,28	s/o	s/o	7,30 %
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	10,16	10,78	-3,47 %	-18,82 %	7,08 %
	Catégorie I (EUR)	10,98	11,63	-3,61 %	-18,94 %	7,08 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	9,24	9,77	-3,61 %	-18,94 %	5,79 %
	Catégorie P (EUR)	9,94	10,51	-3,76 %	-19,07 %	3,55 %
State Street EMU Government Bond Index Fund	Catégorie B (EUR)	11,10	11,92	-3,60 %	-18,54 %	8,39 %
	Catégorie I (EUR)	11,34	12,16	-3,75 %	-18,66 %	8,23 %
	Catégorie P (EUR)	12,00	12,85	-3,91 %	-18,82 %	8,23 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	9,40	10,04	-3,94 %	-18,82 %	8,05 %
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund	Catégorie I (EUR)	11,62	12,30	6,04 %	-9,83 %	8,07 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund	Catégorie B (EUR)	11,83	12,82	-0,96 %	-13,55 %	5,71 %
	Catégorie I (EUR)	13,57	14,69	-1,11 %	-13,68 %	3,94 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	8,90	9,51	-1,11 %	-13,68 %	1,83 %
	Catégorie P (EUR)	10,53	11,38	-1,26 %	-13,81 %	3,98 %
	Catégorie P Distribution (EUR)	8,66	9,26	-1,26 %	-13,81 %	4,02 %

Annexe III – Note pour les investisseurs en Suisse (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Performance (suite)

Nom du Compartiment	Catégories d'actions	VNI au 31 déc. 22	VNI au 31 déc. 23	Performance 2021	Performance 2022	Performance 2023
State Street Global Treasury Bond Index Fund	Catégorie B (USD)	9,09	9,45	-6,67 %	-17,47 %	5,45 %
	Catégorie B Distribution (couverte en GBP)	9,97	10,54	-2,06 %	s/o	5,46 %
	Catégorie I (USD)	9,93	10,32	-6,81 %	-17,6 %	6,33 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)	8,84	9,00	-3,25 %	-13,36 %	3,78 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en EUR)	10,02	10,41	-2,94 %	-12,95 %	4,84 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en EUR) Catégorie I (Portefeuille couvert en GBP)	8,69	8,95	-2,06 %	-12,99 %	2,41 %
		9,56	10,08	-2,27 %	-11,82 %	2,89 %
	Catégorie I Distribution (Portefeuille couvert en GBP)	9,13	9,53	-2,30 %	-11,90 %	-0,93 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en USD)	12,40	13,18	-2,07 %	-10,88 %	-0,93 %
	Catégorie P (USD)	9,75	10,12	-6,96 %	-17,75 %	0,91 %
	Catégorie I (Portefeuille couvert en SGD)	8,74	9,17	s/o	-11,19 %	2,54 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund	Catégorie A (USD)	15,56	15,93	12,58 %	-4,06 %	1,92 %
	Catégorie B (USD)	23,75	24,44	13,13 %	-3,60 %	4,02 %
	Catégorie I (EUR)	18,95	18,77	21,30 %	2,37 %	0,15 %
	Catégorie I Distribution (EUR)	14,05	13,69	21,29 %	2,36 %	6,86 %
	Catégorie I (couverte en EUR)	10,13	10,22	s/o	-3,24 %	25,55 %
	Catégorie I (USD)	28,01	28,72	12,73 %	-3,92 %	23,11 %
	Catégorie P (USD)	18,75	19,11	12,07 %	-4,43 %	1,92 %
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund	Catégorie B (EUR)	12,26	12,75	28,91 %	-2,35 %	4,02 %
	Catégorie I (USD)	14,97	16,00	18,91 %	-9,05 %	6,86 %
State Street Sustainable Climate US Equity Fund	Catégorie I (USD)	9,86	12,37	s/o	s/o	25,55 %
State Street Sustainable Climate World Equity Fund	Catégorie I (USD)	8,67	10,68	s/o	s/o	23,11 %
	Catégorie B Distribution (Portefeuille couvert en GBP)*	s/o	12,24	s/o	s/o	s/o
State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund	Catégorie I (Portefeuille couvert en CHF)*	s/o	10,00	s/o	s/o	s/o
	Catégorie I (USD)*	s/o	10,03	s/o	s/o	s/o

Le Compte de résultat de chaque Compartiment est présenté aux pages 36 à 43 du présent rapport.

* Cette catégorie d'actions a été lancée durant l'exercice clôturé le 31 décembre 2023. Veuillez vous référer à la Note 13 pour plus d'informations.

Annexe IV – Opérations de financement sur titres

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés

Le tableau suivant donne une analyse du montant des titres prêtés, en proportion du total des actifs prêtables et en proportion des actifs sous gestion du compartiment, au 31 décembre 2023 :

	Montant	% d'actifs sous gestion	% d'actifs prêtables
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund (en EUR)	94 830 543	14,56 %	14,71 %
State Street EMU Government Bond Index Fund (en EUR)	5 004 157	1,89 %	1,91 %
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund (en EUR)	2 118 488	3,08 %	3,09 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund (en EUR)	41 563 496	4,86 %	4,93 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund (en EUR)	10 462 887	3,37 %	3,43 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund (en USD)	429 672 830	21,44 %	21,79 %
State Street Global Aggregate Bond Index Fund (en USD)	780 732 314	11,70 %	11,91 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund (en JPY)	2 012 582 021	7,89 %	8,03 %
State Street Switzerland Index Equity Fund (en CHF)	154 314	0,07 %	0,07 %
State Street UK Index Equity Fund (en GBP)	677 196	0,71 %	0,72 %
State Street US Screened Index Equity Fund (en USD)	23 951 266	1,49 %	1,50 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund (en EUR)	3 744 906	1,40 %	1,41 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund (en EUR)	9 433 775	1,49 %	1,50 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund (en USD)	2 909 926	4,36 %	4,40 %
State Street World Screened Index Equity Fund (en USD)	132 189 643	2,83 %	2,86 %
State Street World ESG Index Equity Fund (en USD)	83 773 740	3,48 %	3,51 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund (en USD)	5 322 838	0,85 %	0,86 %
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund (en EUR)	269 267	0,14 %	0,16 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund (en USD)	9 536 162	3,14 %	3,17 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund (en EUR)	4 891 604	1,37 %	1,38 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	14 795 410	2,52 %	2,56 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	2 185 926	2,52 %	2,59 %
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund (en USD)	4 694 277	0,54 %	0,56 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	5 850 225	1,04 %	1,07 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund (en EUR)	1 670 632	6,29 %	6,33 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund (en EUR)	1 112 459	5,10 %	5,17 %
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund (en USD)	825 142	0,35 %	0,36 %

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (suite)

	Montant	% d'actifs sous gestion	% d'actifs prêtables
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund (en USD)	8 446 408	3,03 %	3,05 %
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund (en USD)	1 358 656	1,25 %	1,26 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund (en USD)	1 041 682 968	21,86 %	22,20 %
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	80 384 959	3,53 %	3,66 %
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund (en EUR)	5 222 872	1,89 %	1,91 %
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund (en USD)	631 899	0,12 %	0,12 %
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	14 978 005	4,09 %	4,19 %

Le tableau suivant fournit une analyse des transactions de prêt de titres par contrepartie au 31 décembre 2023, en indiquant les dix principales contreparties pour chaque Compartiment :

	Valeur de marché des prêts de titres
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund (en EUR)	
Barclays PLC	34 653 405
HSBC Bank PLC	24 627 306
Merrill Lynch International	16 406 815
BNP Paribas SA	8 633 475
Goldman Sachs International	7 108 779
Morgan Stanley & Co. International PLC	3 400 763
Total	94 830 543
State Street EMU Government Bond Index Fund (en EUR)	
Merrill Lynch International	4 241 767
Morgan Stanley & Co. International PLC	762 390
Total	5 004 157
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund (en EUR)	
Merrill Lynch International	2 118 488
Total	2 118 488

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (*suite*)

	Valeur de marché des prêts de titres
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund (en EUR)	
Barclays PLC	18 194 010
Citigroup Global Markets Ltd	5 561 853
RBC Europe Ltd	4 927 700
BNP Paribas SA	4 246 620
Goldman Sachs International	2 061 734
Merrill Lynch International	2 012 271
Morgan Stanley & Co. International PLC	1 532 000
HSBC Bank PLC	1 271 878
ING Bank NV	893 183
UBS AG	603 769
<i>Autres</i>	258 478
Total	41 563 496
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund (en EUR)	
Barclays PLC	5 002 660
BNP Paribas SA	1 557 512
RBC Europe Ltd	1 423 340
Morgan Stanley & Co. International PLC	825 620
Goldman Sachs International	706 377
UBS AG	387 527
Merrill Lynch International	210 998
HSBC Bank PLC	176 534
Nomura International PLC	172 319
Total	10 462 887
State Street Global Treasury Bond Index Fund (en USD)	
Barclays PLC	262 970 626
HSBC Bank PLC	55 264 132
Merrill Lynch International	47 632 885
Barclays Capital Securities Ltd	15 114 255
RBC Europe Ltd	14 926 917
BNP Paribas SA	7 424 132
Nomura International PLC	6 255 616
Citigroup Global Markets Ltd	6 151 226
UBS AG	5 897 931
Goldman Sachs International	4 378 171
<i>Autres</i>	3 656 939
Total	429 672 830

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (suite)

	Valeur de marché des prêts de titres
State Street Global Aggregate Bond Index Fund (en USD)	
Barclays PLC	454 892 456
Merrill Lynch International	92 481 894
HSBC Bank PLC	76 237 887
Nomura International PLC	35 435 739
Citigroup Global Markets Ltd	27 442 139
Goldman Sachs International	24 323 916
RBC Europe Ltd	23 923 805
BNP Paribas SA	14 395 034
Morgan Stanley & Co. International PLC	11 731 859
UBS AG	10 972 803
Autres	8 894 782
Total	780 732 314
State Street Japan Screened Index Equity Fund (en JPY)	
JP Morgan Securities PLC	451 230 797
Barclays Capital Securities Ltd	411 121 843
Citigroup Global Markets Ltd	380 070 704
UBS AG	258 692 707
Goldman Sachs International	201 062 063
Societe Generale SA	170 349 450
Morgan Stanley & Co. International PLC	85 349 680
Merrill Lynch International	44 358 254
BNP Paribas Arbitrage SNC	6 338 510
HSBC Bank PLC	4 008 013
Total	2 012 582 021
State Street Switzerland Index Equity Fund (en CHF)	
UBS AG	88 599
Barclays Capital Securities Ltd	65 715
Total	154 314
State Street UK Index Equity Fund (en GBP)	
Societe Generale SA	391 649
Barclays Capital Securities Ltd	167 415
UBS AG	118 132
Total	677 196

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (*suite*)

	Valeur de marché des prêts de titres
State Street US Screened Index Equity Fund (en USD)	
Societe Generale SA	15 192 973
Barclays PLC	7 942 720
HSBC Bank PLC	307 294
UBS AG	260 225
Merrill Lynch International	175 623
Morgan Stanley & Co. International PLC	72 431
Total	23 951 266
State Street EMU Screened Index Equity Fund (en EUR)	
UBS AG	1 030 740
Barclays Capital Securities Ltd	1 029 969
Societe Generale SA	848 864
JP Morgan Securities PLC	679 417
Morgan Stanley & Co. International PLC	128 097
HSBC Bank PLC	27 819
Total	3 744 906
State Street Europe Screened Index Equity Fund (en EUR)	
UBS AG	5 140 665
Barclays Capital Securities Ltd	1 692 344
Societe Generale SA	846 678
JP Morgan Securities PLC	724 048
HSBC Bank PLC	278 066
BNP Paribas Arbitrage SNC	263 491
Citigroup Global Markets Ltd	199 892
Morgan Stanley & Co. International PLC	149 229
Goldman Sachs International	139 362
Total	9 433 775
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund (en USD)	
Goldman Sachs International	1 875 385
BNP Paribas Arbitrage SNC	329 463
UBS AG	291 765
JP Morgan Securities PLC	206 308
Barclays Capital Securities Ltd	169 869
Citigroup Global Markets Ltd	22 339
Morgan Stanley & Co. International PLC	14 797
Total	2 909 926

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (suite)

	Valeur de marché des prêts de titres
State Street World Screened Index Equity Fund (en USD)	
Goldman Sachs International	36 845 032
Societe Generale SA	22 914 135
UBS AG	22 352 074
Barclays PLC	17 458 442
Barclays Capital Securities Ltd	13 088 923
Citigroup Global Markets Ltd	6 632 383
JP Morgan Securities PLC	5 890 983
Merrill Lynch International	3 109 177
BNP Paribas Arbitrage SNC	1 897 742
HSBC Bank PLC	1 593 961
Autres	406 791
Total	132 189 643
State Street World ESG Index Equity Fund (en USD)	
Societe Generale SA	26 878 211
Goldman Sachs International	19 029 727
UBS AG	13 891 095
Barclays PLC	9 191 543
JP Morgan Securities PLC	4 050 391
Citigroup Global Markets Ltd	3 722 656
Merrill Lynch International	3 334 739
HSBC Bank PLC	2 143 919
BNP Paribas Arbitrage SNC	990 896
Morgan Stanley & Co. International PLC	540 563
Total	83 773 740
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund (en USD)	
Goldman Sachs International	1 222 070
JP Morgan Securities PLC	1 071 793
HSBC Bank PLC	827 351
Barclays Capital Securities Ltd	804 729
Morgan Stanley & Co. International PLC	679 853
UBS AG	519 304
Merrill Lynch International	96 805
Societe Generale SA	61 836
Citigroup Global Markets Ltd	38 916
Barclays PLC	181
Total	5 322 838
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund (en EUR)	
UBS AG	178 724
Barclays PLC	90 543
Total	269 267

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (*suite*)

	Valeur de marché des prêts de titres
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund (en USD)	
Barclays Capital Securities Ltd	3 588 737
Goldman Sachs International	2 812 753
Barclays PLC	1 882 930
HSBC Bank PLC	423 410
Macquarie Bank Ltd	308 970
UBS AG	292 079
BNP Paribas Arbitrage SNC	212 300
Merrill Lynch International	14 983
Total	9 536 162
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund (en EUR)	
UBS AG	2 664 856
Barclays Capital Securities Ltd	1 228 067
Societe Generale SA	538 432
BNP Paribas Arbitrage SNC	409 049
Citigroup Global Markets Ltd	28 356
JP Morgan Securities PLC	22 844
Total	4 891 604
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	
Societe Generale SA	7 136 816
Goldman Sachs International	5 189 963
Barclays PLC	1 749 814
Citigroup Global Markets Ltd	460 362
UBS AG	205 014
HSBC Bank PLC	53 441
Total	14 795 410
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	
Barclays PLC	380 608
Citigroup Global Markets Ltd	375 473
Barclays Capital Securities Ltd	364 308
UBS AG	295 723
Goldman Sachs International	280 944
HSBC Bank PLC	271 139
Credit Suisse International	139 189
Macquarie Bank Ltd	78 542
Total	2 185 926
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund (en USD)	
HSBC Bank PLC	3 038 271
JP Morgan Securities PLC	1 656 006
Total	4 694 277

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (*suite*)

	Valeur de marché des prêts de titres
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	
Merrill Lynch International	1 554 945
Morgan Stanley & Co. International PLC	1 357 133
JP Morgan Securities PLC	985 179
Goldman Sachs International	974 752
UBS AG	444 812
HSBC Bank PLC	317 422
BNP Paribas Arbitrage SNC	201 693
Macquarie Bank Ltd	9 696
Citigroup Global Markets Ltd	4 593
Total	5 850 225
State Street EMU ESG Screened Equity Fund (en EUR)	
UBS AG	561 941
Barclays Capital Securities Ltd	473 233
HSBC Bank PLC	473 164
BNP Paribas Arbitrage SNC	144 914
Merrill Lynch International	10 681
Macquarie Bank Ltd	6 699
Total	1 670 632
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund (en EUR)	
UBS AG	484 032
Barclays Capital Securities Ltd	256 562
JP Morgan Securities PLC	166 408
Societe Generale SA	131 853
HSBC Bank PLC	60 307
Merrill Lynch International	13 297
Total	1 112 459
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund (en USD)	
Citigroup Global Markets Ltd	324 007
HSBC Bank PLC	276 779
JP Morgan Securities PLC	224 344
Credit Suisse International	12
Total	825 142

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (*suite*)

	Valeur de marché des prêts de titres
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund (en USD)	
UBS AG	2 703 308
HSBC Bank PLC	2 324 034
Citigroup Global Markets Ltd	1 662 854
Goldman Sachs International	615 566
Merrill Lynch International	536 196
Credit Suisse International	451 470
Barclays Capital Securities Ltd	152 980
Total	8 446 408
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund (en USD)	
Morgan Stanley & Co. International PLC	1 358 656
Total	1 358 656
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund (en USD)	
Barclays PLC	601 236 588
HSBC Bank PLC	114 928 565
Merrill Lynch International	95 827 193
BNP Paribas SA	85 264 725
Barclays Capital Securities Ltd	49 392 162
Citigroup Global Markets Ltd	32 542 575
RBC Europe Ltd	32 524 426
UBS AG	13 201 180
Goldman Sachs International	9 315 524
JP Morgan Securities PLC	7 450 030
Total	1 041 682 968
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	
BNP Paribas SA	46 070 135
JP Morgan Securities PLC	21 914 028
Barclays PLC	12 400 796
Total	80 384 959
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund (en EUR)	
BNP Paribas SA	3 484 605
Merrill Lynch International	1 291 447
UBS AG	446 820
Total	5 222 872
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund (en USD)	
BNP Paribas SA	631 899
Total	631 899

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (suite)

	Valeur de marché des prêts de titres
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	
BNP Paribas SA	9 361 800
JP Morgan Securities PLC	3 866 693
Barclays PLC	1 749 512
Total	14 978 005

Le tableau suivant fournit une analyse des pays des contreparties et des échéances restant à courir des transactions de prêt de titres au 31 décembre 2023, en indiquant les dix principaux pays pour chaque Compartiment :

	State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund (en EUR)	State Street EMU Government Bond Index Fund (en EUR)	State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund (en EUR)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Au-delà d'un an	94 830 543	5 004 157	2 118 488
Total	94 830 543	5 004 157	2 118 488
Échéance restant à courir par pays			
France	8 633 475	0	0
Royaume-Uni	86 197 068	5 004 157	2 118 488
Total	94 830 543	5 004 157	2 118 488

	State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund (en EUR)	State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund (en EUR)	State Street Global Treasury Bond Index Fund (en USD)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Au-delà d'un an	41 563 496	10 462 887	429 672 830
Total	41 563 496	10 462 887	429 672 830
Échéance restant à courir par pays			
France	4 246 620	1 557 513	7 424 132
Pays-Bas	893 183	0	0
Suisse	603 769	387 527	5 897 931
Royaume-Uni	35 819 924	8 517 847	416 350 767
Total	41 563 496	10 462 887	429 672 830

	State Street Global Aggregate Bond Index Fund (en USD)	State Street Japan Screened Index Equity Fund (en JPY)	State Street Switzerland Index Equity Fund (en CHF)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Au-delà d'un an	780 732 314	0	0
Échéance ouverte	0	2 012 582 021	154 314
Total	780 732 314	2 012 582 021	154 314

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (suite)

	State Street Global Aggregate Bond Index Fund (en USD)	State Street Japan Screened Index Equity Fund (en JPY)	State Street Switzerland Index Equity Fund (en CHF)
Échéance restant à courir par pays			
France	14 395 034	176 687 960	0
Suisse	10 972 803	258 692 707	88 599
Royaume-Uni	755 364 477	1 577 201 354	65 715
Total	780 732 314	2 012 582 021	154 314

	State Street UK Index Equity Fund (en GBP)	State Street US Screened Index Equity Fund (en USD)	State Street EMU Screened Index Equity Fund (en EUR)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Échéance ouverte	677 196	23 951 266	3 744 906
Total	677 196	23 951 266	3 744 906

Échéance restant à courir par pays			
France	391 649	15 192 973	848 864
Suisse	118 132	260 225	1 030 740
Royaume-Uni	167 415	8 498 068	1 865 302
Total	677 196	23 951 266	3 744 906

	State Street Europe Screened Index Equity Fund (en EUR)	State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund (en USD)	State Street World Screened Index Equity Fund (en USD)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Échéance ouverte	9 433 775	2 909 926	132 189 643
Total	9 433 775	2 909 926	132 189 643

Échéance restant à courir par pays			
France	1 110 169	329 463	24 811 877
Suisse	5 140 666	291 765	22 352 074
Royaume-Uni	3 182 940	2 288 698	85 025 692
Total	9 433 775	2 909 926	132 189 643

	State Street World ESG Index Equity Fund (en USD)	State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund (en USD)	State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund (en EUR)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Au-delà d'un an	0	0	269 267
Échéance ouverte	83 773 740	5 322 838	0
Total	83 773 740	5 322 838	269 267

Échéance restant à courir par pays			
France	27 869 108	61 836	0
Suisse	13 891 095	519 304	178 724
Royaume-Uni	42 013 537	4 741 698	90 543
Total	83 773 740	5 322 838	269 267

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (suite)

	State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund (en USD)	State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund (en EUR)	State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Échéance ouverte	9 536 162	4 891 604	14 795 410
Total	9 536 162	4 891 604	14 795 410
Échéance restant à courir par pays			
Australie	308 970	0	0
France	212 300	947 481	7 136 817
Suisse	292 079	2 664 856	205 014
Royaume-Uni	8 722 813	1 279 267	7 453 579
Total	9 536 162	4 891 604	14 795 410
	State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund (en USD)	State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Échéance ouverte	2 185 926	4 694 277	5 850 225
Total	2 185 926	4 694 277	5 850 225
Échéance restant à courir par pays			
Australie	78 542	0	9 696
France	0	0	201 693
Suisse	295 723	0	444 812
Royaume-Uni	1 811 661	4 694 277	5 194 024
Total	2 185 926	4 694 277	5 850 225
	State Street EMU ESG Screened Equity Fund (en EUR)	State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund (en EUR)	State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund (en USD)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Échéance ouverte	1 670 632	1 112 459	825 142
Total	1 670 632	1 112 459	825 142
Échéance restant à courir par pays			
Australie	6 699	0	0
France	144 914	131 853	0
Suisse	561 942	484 033	0
Royaume-Uni	957 077	496 573	825 142
Total	1 670 632	1 112 459	825 142

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (suite)

	State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund (en USD)	State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund (en USD)	State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund (en USD)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Au-delà d'un an	0	0	1 041 682 968
Échéance ouverte	8 446 408	1 358 656	0
Total	8 446 408	1 358 656	1 041 682 968

Échéance restant à courir par pays			
France	0	0	85 264 725
Suisse	2 703 309	0	13 201 180
Royaume-Uni	5 743 099	1 358 656	943 217 063
Total	8 446 408	1 358 656	1 041 682 968

	State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund (en EUR)	State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund (en USD)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Au-delà d'un an	80 384 959	5 222 872	631 899
Total	80 384 959	5 222 872	631 899

Échéance restant à courir par pays			
France	46 070 135	3 484 605	631 899
Suisse	0	446 820	0
Royaume-Uni	34 314 824	1 291 447	0
Total	80 384 959	5 222 872	631 899

	State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres	
Un à trois mois*	3 734 211
Au-delà d'un an	11 243 794
Total	14 978 005
Échéance restant à courir par pays	
France	9 361 800
Royaume-Uni	5 616 205
Total	14 978 005

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Titres prêtés (*suite*)

Le tableau suivant fournit une analyse des émetteurs des garanties non numéraires reçues* par les Compartiments à l'égard des transactions de prêt de titres, au 31 décembre 2023, en indiquant les dix émetteurs principaux pour chaque Compartiment :

	Garanties non numéraires reçues*
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund (en EUR)	
Government of Japan	19 726 136
Government of United Kingdom	14 573 864
Government of United States	11 187 986
Government of Germany	10 826 378
Government of France	6 574 103
Government of European Union	5 966 136
Government of Netherlands	5 327 358
Asian Development Bank	5 324 948
European Investment Bank	4 380 798
Government of Belgium	3 060 323
<i>Autres</i>	<i>13 113 251</i>
Total	100 061 281
State Street EMU Government Bond Index Fund (en EUR)	
Government of Japan	1 154 985
Government of European Union	1 058 888
European Investment Bank	492 534
Asian Development Bank	948 083
Government of United States	439 150
Government of France	339 112
Government of United Kingdom	258 999
Government of Germany	210 619
Inter-American Development Bank	177 164
Government of Netherlands	92 074
<i>Autres</i>	<i>81 329</i>
Total	5 252 937
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund (en EUR)	
Government of European Union	765 569
Asian Development Bank	682 351
Government of United Kingdom	129 166
European Investment Bank	354 485
Inter-American Development Bank	127 508
Government of Germany	58 771
Government of United States	56 828
International Bank for Reconstruction & Development	25 544
Government of Austria	15 011
Government of France	1 501
Total	2 216 734

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund (en EUR)	
Government of United Kingdom	7 570 868
Government of France	7 013 506
Government of Japan	4 799 179
Government of Germany	6 624 082
Government of United States	3 451 255
Government of European Union	2 631 022
Asian Development Bank	2 077 651
Government of Netherlands	1 718 034
Government of the Hong Kong	1 210 290
Inter-American Development Bank	853 573
<i>Autres</i>	<i>5 505 470</i>
Total	43 454 930
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund (en EUR)	
Government of France	2 399 914
Government of United Kingdom	2 236 985
Government of United States	1 059 742
Government of Germany	2 114 841
Government of Japan	946 750
Government of Netherlands	536 971
Government of the Hong Kong	418 891
Government of European Union	142 833
Government of Austria	116 629
Asian Development Bank	68 028
<i>Autres</i>	<i>876 880</i>
Total	10 918 464
State Street Global Treasury Bond Index Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	38 630 922
Government of Japan	34 447 790
Netflix Inc	19 117 552
Microsoft Corp	26 545 079
Spotify Technology SA	17 204 646
Snowflake Inc	17 067 946
NVIDIA Corp	16 647 363
Costco Wholesale Corp	15 375 239
Hologic Inc	11 714 390
VeriSign Inc	10 919 361
<i>Autres</i>	<i>259 421 325</i>
Total	467 091 613

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street Global Aggregate Bond Index Fund (en USD)	
Government of Japan	82 729 736
Government of United Kingdom	78 499 384
Netflix Inc	32 792 302
Microsoft Corp	44 936 272
Spotify Technology SA	29 511 097
Snowflake Inc	29 276 617
NVIDIA Corp	28 555 191
Costco Wholesale Corp	26 373 120
Hologic Inc	20 093 672
Government of France	20 065 346
<i>Autres</i>	451 632 575
Total	844 465 312
State Street Japan Screened Index Equity Fund (en JPY)	
Government of United Kingdom	368 216 677
Government of France	307 508 340
Government of Germany	233 554 111
Government of United States	240 144 608
Government of Belgium	147 287 839
Government of Canada	78 383 768
Government of Sweden	66 892 646
Government of Netherlands	53 105 157
Microsoft Corp	38 890 794
Enel SpA	34 365 469
<i>Autres</i>	563 993 834
Total	2 132 343 243
State Street Switzerland Index Equity Fund (en CHF)	
Government of United Kingdom	31 762
Government of Belgium	26 311
SCREEN Holdings Co Ltd	13 117
Government of France	15 603
Government of United States	11 446
RWE AG	7 825
Fujitsu Ltd	6 947
Hitachi Construction Machinery Co Ltd	5 065
Akzo Nobel NV	4 939
Government of Germany	4 669
<i>Autres</i>	35 875
Total	163 559

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street UK Index Equity Fund (en GBP)	
UniCredit SpA	73 590
SCREEN Holdings Co Ltd	43 292
ITOCHU Corp	28 642
Anheuser-Busch InBev SA/NV	34 720
RWE AG	25 829
Meituan	23 759
Fujitsu Ltd	22 930
Origin Energy Ltd	21 617
MEG Energy Corp	18 604
CSL Ltd	18 190
<i>Autres</i>	416 042
Total	727 215
State Street US Screened Index Equity Fund (en USD)	
BHP Group Ltd	3 451 652
Macquarie Group Ltd	3 306 871
Coles Group Ltd	1 148 164
Toyota Tsusho Corp	1 432 613
National Australia Bank Ltd	1 031 321
Tencent Holdings Ltd	940 851
Government of United States	798 864
Kansai Electric Power Co Inc/The	617 101
Samsara Inc	501 840
Dell Technologies Inc	487 449
<i>Autres</i>	12 709 088
Total	26 425 814
State Street EMU Screened Index Equity Fund (en EUR)	
SCREEN Holdings Co Ltd	224 380
UniCredit SpA	202 686
Government of United States	146 038
Microsoft Corp	166 432
RWE AG	133 867
Fujitsu Ltd	118 841
Verizon Communications Inc	115 927
Government of Canada	107 105
Government of Netherlands	105 357
Government of Belgium	100 722
<i>Autres</i>	2 619 135
Total	4 040 490

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street Europe Screened Index Equity Fund (en EUR)	
Microsoft Corp	682 074
Verizon Communications Inc	584 594
Government of United Kingdom	398 660
AT&T Inc	431 742
SCREEN Holdings Co Ltd	374 433
Government of France	366 452
Nintendo Co Ltd	351 877
Government of Germany	331 697
Medtronic PLC	326 963
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	313 996
<i>Autres</i>	<i>6 021 441</i>
Total	10 183 929
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	847 435
Government of United States	634 438
Government of Germany	373 669
Government of France	465 479
Government of Belgium	146 590
Government of Canada	76 450
UnitedHealth Group Inc	43 435
Chr Hansen Holding A/S	35 606
Merck & Co Inc	35 606
Amazon.com Inc	35 606
<i>Autres</i>	<i>401 401</i>
Total	3 095 715
State Street World Screened Index Equity Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	20 065 770
Government of United States	15 136 937
Government of Germany	11 444 796
Government of France	13 369 424
Government of Belgium	3 896 244
UniCredit SpA	2 970 159
Microsoft Corp	2 627 063
BHP Group Ltd	1 863 858
Government of Sweden	1 629 761
Macquarie Group Ltd	1 593 132
<i>Autres</i>	<i>67 114 313</i>
Total	141 711 457

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street World ESG Index Equity Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	10 019 920
Government of United States	7 221 222
Government of Germany	5 453 968
Government of France	7 168 809
UniCredit SpA	3 059 855
BHP Group Ltd	2 412 819
Macquarie Group Ltd	2 100 251
Government of Belgium	1 997 922
Microsoft Corp	1 489 224
Anheuser-Busch InBev SA/NV	1 477 108
<i>Autres</i>	<i>47 881 154</i>
Total	90 282 252
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	1 049 935
Government of France	741 443
Government of Germany	535 747
Government of United States	716 476
Government of Belgium	462 725
Government of Canada	206 712
Government of Austria	165 846
Government of Sweden	131 076
Enel SpA	71 743
Alfa Laval AB	71 743
<i>Autres</i>	<i>1 456 715</i>
Total	5 610 161
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund (en EUR)	
Government of Germany	70 024
Government of United Kingdom	55 131
Government of Austria	31 166
Government of France	37 171
Government of Netherlands	28 786
Singapore Government Bond	23 743
Government of United States	20 303
Government of the Hong Kong	798
Government of Finland	432
Government of Australia	52
<i>Autres</i>	<i>11 248</i>
Total	278 854

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	1 799 353
Government of France	1 272 029
Government of United States	761 577
Government of Germany	1 210 410
Government of Belgium	623 164
Government of Sweden	469 628
Government of Canada	222 160
SCREEN Holdings Co Ltd	181 268
Samsara Inc	128 043
Dell Technologies Inc	124 371
<i>Autres</i>	3 338 272
Total	10 130 275
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund (en EUR)	
Microsoft Corp	380 464
SCREEN Holdings Co Ltd	319 153
UniCredit SpA	236 143
Verizon Communications Inc	298 754
AT&T Inc	215 797
RWE AG	190 409
Nintendo Co Ltd	179 825
Fujitsu Ltd	169 037
Medtronic PLC	167 093
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	160 466
<i>Autres</i>	2 944 898
Total	5 262 039
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	2 125 332
Government of United States	1 504 453
BHP Group Ltd	1 101 751
Government of France	1 214 995
Government of Germany	1 092 357
Macquarie Group Ltd	1 024 368
Toyota Tsusho Corp	443 780
UniCredit SpA	432 528
Coles Group Ltd	357 424
National Australia Bank Ltd	346 237
<i>Autres</i>	6 422 724
Total	16 065 949

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	330 234
Government of France	252 491
Government of Germany	152 798
Government of United States	198 883
Government of Belgium	69 150
SCREEN Holdings Co Ltd	48 915
Microsoft Corp	38 057
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	29 611
RWE AG	29 183
Government of Sweden	28 671
<i>Autres</i>	<i>1 154 831</i>
Total	2 332 824
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund (en USD)	
GSK PLC	317 656
National Grid PLC	317 656
Alphabet Inc	317 656
Experian PLC	317 656
Compass Group PLC	317 656
Diageo PLC	317 655
Whitbread PLC	317 655
Auto Trader Group PLC	276 420
Flutter Entertainment PLC	259 633
Enel SpA	182 021
<i>Autres</i>	<i>2 055 103</i>
Total	4 996 767
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	
Government of France	1 125 290
Government of United Kingdom	889 408
Government of United States	679 098
Government of Germany	781 016
Government of Belgium	578 626
Government of Netherlands	442 869
Government of Austria	368 302
Enel SpA	90 456
Alfa Laval AB	90 456
Dechra Pharmaceuticals PLC	90 456
<i>Autres</i>	<i>1 061 522</i>
Total	6 197 499

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street EMU ESG Screened Equity Fund (en EUR)	
SCREEN Holdings Co Ltd	122 207
Microsoft Corp	86 639
Fujitsu Ltd	64 726
RWE AG	72 910
Alphabet Inc	64 262
Verizon Communications Inc	63 309
AT&T Inc	61 453
National Grid PLC	50 610
GSK PLC	48 553
Experian PLC	48 553
<i>Autres</i>	<i>1 111 370</i>
Total	1 794 592
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund (en EUR)	
Microsoft Corp	69 495
Verizon Communications Inc	54 955
UniCredit SpA	48 839
SCREEN Holdings Co Ltd	53 176
AT&T Inc	39 696
Nintendo Co Ltd	33 079
RWE AG	31 725
Medtronic PLC	30 736
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	29 518
Government of Belgium	29 491
<i>Autres</i>	<i>779 166</i>
Total	1 199 876
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	95 452
Government of United States	91 732
Government of Germany	39 243
Government of France	84 233
GSK PLC	29 375
Alphabet Inc	29 375
Experian PLC	29 375
National Grid PLC	29 375
Compass Group PLC	29 375
Diageo PLC	29 375
<i>Autres</i>	<i>391 305</i>
Total	878 215

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund (en USD)	
Government of United Kingdom	1 660 976
Government of France	1 473 649
Government of Germany	702 609
Government of United States	862 696
Government of Belgium	423 022
Microsoft Corp	290 695
Prysmian SpA	288 632
Aviva PLC	288 388
Iveco Group NV	288 207
Acerinox SA	288 082
<i>Autres</i>	<i>2 349 802</i>
Total	8 916 758
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund (en USD)	
Government of Netherlands	350 194
Government of United Kingdom	350 194
Government of Germany	350 194
Government of United States	350 194
Government of France	89 908
Government of Belgium	5
Total	1 490 689
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund (en USD)	
Government of Japan	147 360 901
Government of United Kingdom	99 222 984
Netflix Inc	43 653 163
Microsoft Corp	59 436 031
Spotify Technology SA	39 285 217
Snowflake Inc	38 973 077
NVIDIA Corp	38 012 713
Costco Wholesale Corp	35 107 937
Hologic Inc	26 748 727
VeriSign Inc	24 711 131
<i>Autres</i>	<i>574 951 679</i>
Total	1 127 463 560

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	
Government of Germany	19 443 346
Government of Netherlands	16 102 677
Government of Japan	13 273 407
Government of France	14 632 420
New Zealand Government Inflation Linked Bond	7 292 455
Government of Australia	5 625 633
Government of United States	5 413 978
Government of United Kingdom	1 064 463
Government of the Hong Kong	494 067
Government of Canada	199 646
<i>Autres</i>	414 313
Total	83 956 405
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund (en EUR)	
Government of France	1 156 714
Government of Germany	904 333
Government of the Hong Kong	948 634
Government of Netherlands	836 590
Government of European Union	465 847
Asian Development Bank	416 005
European Investment Bank	216 117
Government of United Kingdom	159 765
Government of Austria	84 913
Inter-American Development Bank	77 737
<i>Autres</i>	156 912
Total	5 423 567
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund (en USD)	
Government of France	196 115
Government of Germany	195 007
Government of the Hong Kong	63 663
Government of Netherlands	189 624
Government of Japan	4 632
Government of United Kingdom	1 829
Government of Sweden	128
Government of European Union	82
Total	651 080

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	Garanties non numéraires reçues*
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	
Government of Germany	4 097 147
Government of Netherlands	3 272 640
New Zealand Government Inflation Linked Bond	1 384 405
Government of France	3 021 570
Government of Australia	1 068 267
Government of United States	1 061 275
Government of Japan	1 035 281
Government of United Kingdom	391 426
Government of the Hong Kong	93 884
Government of Canada	37 901
<i>Autres</i>	150 205
Total	15 614 001

Le tableau suivant fournit une analyse des garanties non numéraires reçues* par les Compartiments à l'égard des transactions de prêt de titres, au 31 décembre 2023 :

	State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund (en EUR)	State Street EMU Government Bond Index Fund (en EUR)	State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund (en EUR)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Revenu fixe	100 061 281	5 252 937	2 216 734
Obligations d'État	100 061 281	5 252 937	2 216 734
Total des garanties non numéraires	100 061 281	5 252 937	2 216 734
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	5 734 801	870 798	626 727
Notation < AA- (Valeur)	27 088	4 823	3 471
Qualité <i>non-investment grade</i>	94 299 392	4 377 316	1 586 536
Total	100 061 281	5 252 937	2 216 734
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Inférieure à un mois	496 080	0	0
Une semaine à un mois	3 936 301	69 091	49 726
Un à trois mois	10 030 644	1 307 130	1 502
Trois mois à un an	13 180 667	643 492	394 711
Au-delà d'un an	72 417 589	3 233 224	1 770 795
Total	100 061 281	5 252 937	2 216 734
Compartiments par devise			
EUR	85 513 614	3 831 628	2 216 734
GBP	11 688 778	1 363 272	0
USD	2 858 889	58 037	0
Total	100 061 281	5 252 937	2 216 734

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund (en EUR)	State Street EMU Government Bond Index Fund (en EUR)	State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund (en EUR)
Montants par agent tripartite			
Triparty	100 061 281	5 252 937	2 216 734
Bank of New York Mellon	7 933 660	0	0
Euroclear	72 867 240	5 252 937	2 216 734
Clearstream	19 260 381	0	0
Total	100 061 281	5 252 937	2 216 734
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	100 061 281	5 252 937	2 216 734
Total	100 061 281	5 252 937	2 216 734
	State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund (en EUR)	State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund (en EUR)	State Street Global Treasury Bond Index Fund (en USD)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Revenu fixe	43 454 930	10 918 464	467 091 613
Obligations d'État	43 454 930	10 918 464	467 091 613
Total des garanties non numéraires	43 454 930	10 918 464	467 091 613
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	3 274 326	619 545	3 090 145
Notation < AA- (Valeur)	8 437	2 805	41 297
Qualité <i>non-investment grade</i>	40 172 167	10 296 114	463 960 171
Total	43 454 930	10 918 464	467 091 613
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Inférieure à un mois	50 507	22 572	256 145
Une semaine à un mois	941 419	230 561	4 442 901
Un à trois mois	2 975 265	578 676	14 002 693
Trois mois à un an	3 615 569	978 267	9 102 946
Au-delà d'un an	35 872 170	9 108 388	439 286 928
Total	43 454 930	10 918 464	467 091 613
Compartiments par devise			
EUR	39 915 779	10 050 017	53 767 535
GBP	1 451 525	391 932	42 455 027
USD	2 087 626	476 515	370 869 051
Total	43 454 930	10 918 464	467 091 613
Montants par agent tripartite			
Triparty	43 454 930	10 918 464	467 091 613
Bank of New York Mellon	2 136 857	728 537	322 950 778
Euroclear	25 685 661	5 256 824	83 959 896
JP Morgan Chase & Co.	0	0	49 560 087
Clearstream	15 632 412	4 933 103	10 620 852
Total	43 454 930	10 918 464	467 091 613

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund (en EUR)	State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund (en EUR)	State Street Global Treasury Bond Index Fund (en USD)
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	43 454 930	10 918 464	467 091 613
Total	43 454 930	10 918 464	467 091 613

	State Street Global Aggregate Bond Index Fund (en USD)	State Street Japan Screened Index Equity Fund (en JPY)	State Street Switzerland Index Equity Fund (en CHF)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Actions	0	626 619 785	70 103
Titres cotés	0	626 619 785	70 103
Revenu fixe	844 465 312	1 505 723 458	93 456
Obligations d'État	844 465 312	1 505 723 458	93 456
Total des garanties non numéraires	844 465 312	2 132 343 243	163 559
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	13 477 086	8 543 770	0
Notation < AA- (Valeur)	100 372	0	0
Qualité <i>non-investment grade</i>	830 887 854	2 123 799 473	163 559
Total	844 465 312	2 132 343 243	163 559
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Inférieure à un mois	493 392	0	0
Une semaine à un mois	8 494 451	63 081 170	0
Un à trois mois	29 452 031	175 281	3 375
Trois mois à un an	25 930 989	98 065 016	3 641
Au-delà d'un an	780 094 449	1 344 401 991	86 440
Échéance ouverte	0	626 619 785	70 103
Total	844 465 312	2 132 343 243	163 559
Compartiments par devise			
EUR	141 280 118	0	0
GBP	86 951 766	0	0
USD	616 233 428	2 132 343 243	163 559
Total	844 465 312	2 132 343 243	163 559
Montants par agent tripartite			
Agent tripartite	844 465 312	2 132 343 243	163 559
Bank of New York Mellon	547 790 413	1 239 337 194	163 559
Euroclear	181 250 328	0	0
JP Morgan Chase & Co.	85 133 105	893 006 049	0
Clearstream	30 291 466	0	0
Total	844 465 312	2 132 343 243	163 559

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street Global Aggregate Bond Index Fund (en USD)	State Street Japan Screened Index Equity Fund (en JPY)	State Street Switzerland Index Equity Fund (en CHF)
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	844 465 312	2 132 343 243	163 559
Total	844 465 312	2 132 343 243	163 559
	State Street UK Index Equity Fund (en GBP)	State Street US Screened Index Equity Fund (en USD)	State Street EMU Screened Index Equity Fund (en EUR)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Actions	725 176	25 041 939	3 428 743
Titres cotés	725 176	25 041 939	3 428 743
Revenu fixe	2 039	1 383 875	611 747
Obligations d'État	2 039	1 383 875	611 747
Total des garanties non numéraires	727 215	26 425 814	4 040 490
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	0	0	53 635
Qualité <i>non-investment grade</i>	727 215	26 425 814	3 986 855
Total	727 215	26 425 814	4 040 490
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Inférieure à un mois	0	450	0
Un à trois mois	0	62 252	0
Trois mois à un an	0	21 795	0
Au-delà d'un an	2 039	1 299 378	611 747
Échéance ouverte	725 176	25 041 939	3 428 743
Total	727 215	26 425 814	4 040 490
Compartiments par devise			
USD	727 215	26 425 814	4 040 490
Total	727 215	26 425 814	4 040 490
Montants par agent tripartite			
Triparty	727 215	26 425 814	4 040 490
Bank of New York Mellon	727 215	26 087 863	3 278 022
JP Morgan Chase & Co.	0	337 951	762 468
Total	727 215	26 425 814	4 040 490
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	727 215	26 425 814	4 040 490
Total	727 215	26 425 814	4 040 490

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street Europe Screened Index Equity Fund (en EUR)	State Street Pacific Ex- Japan Screened Index Equity Fund (en USD)	State Street World Screened Index Equity Fund (en USD)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Actions	8 807 621	534 565	72 008 418
Titres cotés	8 807 621	534 565	72 008 418
Revenu fixe	1 376 308	2 561 150	69 703 039
Obligations d'État	1 376 308	2 561 150	69 703 039
Total des garanties non numéraires	10 183 929	3 095 715	141 711 457
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	27 322	106 850	2 911 784
Qualité <i>non-investment grade</i>	10 156 607	2 988 865	138 799 673
Total	10 183 929	3 095 715	141 711 457
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Inférieure à un mois	0	0	1 806
Une semaine à un mois	0	914	1 519 857
Un à trois mois	0	11 069	24 619
Trois mois à un an	320 172	11 943	1 409 820
Au-delà d'un an	1 056 136	2 537 224	66 746 937
Échéance ouverte	8 807 621	534 565	72 008 418
Total	10 183 929	3 095 715	141 711 457
Compartiments par devise			
USD	10 183 929	3 095 715	141 711 457
Total	10 183 929	3 095 715	141 711 457
Montants par agent tripartite			
Triparty	10 183 929	3 095 715	141 711 457
Bank of New York Mellon	8 593 509	2 499 060	124 577 210
JP Morgan Chase & Co.	1 590 420	596 655	17 134 247
Total	10 183 929	3 095 715	141 711 457
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	10 183 929	3 095 715	141 711 457
Total	10 183 929	3 095 715	141 711 457

	State Street World ESG Index Equity Fund (en USD)	State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund (en USD)	State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund (en EUR)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Actions	55 550 879	1 508 095	0
Titres cotés	55 550 879	1 508 095	0
Revenu fixe	34 731 373	4 102 066	278 854
Obligations d'État	34 731 373	4 102 066	278 854
Total des garanties non numéraires	90 282 252	5 610 161	278 854

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street World ESG Index Equity Fund (en USD)	State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund (en USD)	State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund (en EUR)
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	1 560 439	243 362	31 236
Qualité <i>non-investment grade</i>	88 721 813	5 366 799	247 618
Total	90 282 252	5 610 161	278 854
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Inférieure à un mois	1 754	61	0
Une semaine à un mois	0	123 608	308
Un à trois mois	135 068	15 373	7 667
Trois mois à un an	917 638	28 506	9 318
Au-delà d'un an	33 676 913	3 934 518	261 561
Échéance ouverte	55 550 879	1 508 095	0
Total	90 282 252	5 610 161	278 854
Compartiments par devise			
EUR	0	0	243 643
USD	90 282 252	5 610 161	35 211
Total	90 282 252	5 610 161	278 854
Montants par agent tripartite			
Triparty	90 282 252	5 610 161	278 854
Bank of New York Mellon	78 672 584	3 565 787	0
JP Morgan Chase & Co.	11 609 668	2 044 374	0
Clearstream	0	0	278 854
Total	90 282 252	5 610 161	278 854
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	90 282 252	5 610 161	278 854
Total	90 282 252	5 610 161	278 854

	State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund (en USD)	State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund (en EUR)	State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Actions	3 707 076	5 184 705	10 062 234
Titres cotés	3 707 076	5 184 705	10 062 234
Revenu fixe	6 423 199	77 334	6 003 715
Obligations d'État	6 423 199	77 334	6 003 715
Total des garanties non numéraires	10 130 275	5 262 039	16 065 949
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	134 146	0	268 164
Qualité <i>non-investment grade</i>	9 996 129	5 262 039	15 797 785
Total	10 130 275	5 262 039	16 065 949

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund (en USD)	State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund (en EUR)	State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Une semaine à un mois	442 869	0	0
Un à trois mois	2	0	0
Trois mois à un an	21 863	6 669	71 806
Au-delà d'un an	5 958 465	70 665	5 931 909
Échéance ouverte	3 707 076	5 184 705	10 062 234
Total	10 130 275	5 262 039	16 065 949
Compartiments par devise			
USD	10 130 275	5 262 039	16 065 949
Total	10 130 275	5 262 039	16 065 949
Montants par agent tripartite			
Triparty	10 130 275	5 262 039	16 065 949
Bank of New York Mellon	9 113 650	4 760 376	15 514 427
JP Morgan Chase & Co.	1 016 625	501 663	551 522
Total	10 130 275	5 262 039	16 065 949
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	10 130 275	5 262 039	16 065 949
Total	10 130 275	5 262 039	16 065 949
État des garanties non numéraires			
	State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund (en USD)	State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Actions	1 275 078	4 956 531	1 139 190
Titres cotés	1 275 078	4 956 531	1 139 190
Revenu fixe	1 057 746	40 236	5 058 309
Obligations d'État	1 057 746	40 236	5 058 309
Total des garanties non numéraires	2 332 824	4 996 767	6 197 499
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	13 610	0	561 154
Qualité <i>non-investment grade</i>	2 319 214	4 996 767	5 636 345
Total	2 332 824	4 996 767	6 197 499
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Inférieure à un mois	0	0	412
Une semaine à un mois	27 038	0	0
Un à trois mois	612	0	25 478
Trois mois à un an	26 022	0	29 657
Au-delà d'un an	1 004 074	40 236	5 002 762
Échéance ouverte	1 275 078	4 956 531	1 139 190
Total	2 332 824	4 996 767	6 197 499

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund (en USD)	State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)
Compartiments par devise			
USD	2 332 824	4 996 767	6 197 499
Total	2 332 824	4 996 767	6 197 499
Montants par agent tripartite			
Triparty	2 332 824	4 996 767	6 197 499
Bank of New York Mellon	1 419 570	0	4 565 235
JP Morgan Chase & Co.	913 254	4 996 767	1 632 264
Total	2 332 824	4 996 767	6 197 499
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	2 332 824	4 996 767	6 197 499
Total	2 332 824	4 996 767	6 197 499

	State Street EMU ESG Screened Equity Fund (en EUR)	State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund (en EUR)	State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund (en USD)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Actions	1 743 757	1 045 273	567 555
Titres cotés	1 743 757	1 045 273	567 555
Revenu fixe	50 835	154 603	310 660
Obligations d'État	50 835	154 603	310 660
Total des garanties non numéraires	1 794 592	1 199 876	878 215
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	27	10 365	0
Qualité <i>non-investment grade</i>	1 794 565	1 189 511	878 215
Total	1 794 592	1 199 876	878 215
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Trois mois à un an	1 092	1 725	0
Au-delà d'un an	49 743	152 878	310 660
Échéance ouverte	1 743 757	1 045 273	567 555
Total	1 794 592	1 199 876	878 215
Compartiments par devise			
USD	1 794 592	1 199 876	878 215
Total	1 794 592	1 199 876	878 215
Montants par agent tripartite			
Triparty	1 794 592	1 199 876	878 215
Bank of New York Mellon	1 120 868	956 301	0
JP Morgan Chase & Co.	673 724	243 575	878 215
Total	1 794 592	1 199 876	878 215

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street EMU ESG Screened Equity Fund (en EUR)	State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund (en EUR)	State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund (en USD)
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	1 794 592	1 199 876	878 215
Total	1 794 592	1 199 876	878 215
	State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund (en USD)	State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund (en USD)	State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund (en USD)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Actions	3 527 155	0	0
Titres cotés	3 527 155	0	0
Revenu fixe	5 389 603	1 490 689	1 127 463 560
Obligations d'État	5 389 603	1 490 689	1 127 463 560
Total des garanties non numéraires	8 916 758	1 490 689	1 127 463 560
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	23 642	0	6 966 534
Notation < AA- (Valeur)	0	0	9 123
Qualité <i>non-investment grade</i>	8 893 116	1 490 689	1 120 487 903
Total	8 916 758	1 490 689	1 127 463 560
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Inférieure à un mois	4	0	1 024 631
Une semaine à un mois	23 390	0	11 677 297
Un à trois mois	9	0	35 098 055
Trois mois à un an	106 035	0	22 317 803
Au-delà d'un an	5 260 165	1 490 689	1 057 345 774
Échéance ouverte	3 527 155	0	0
Total	8 916 758	1 490 689	1 127 463 560
Compartiments par devise			
EUR	0	0	126 625 708
GBP	0	0	112 820 123
USD	8 916 758	1 490 689	888 017 729
Total	8 916 758	1 490 689	1 127 463 560
Montants par agent tripartite			
Triparty	8 916 758	1 490 689	1 127 463 560
Bank of New York Mellon	4 283 361	1 490 689	747 222 113
Euroclear	0	0	218 211 842
JP Morgan Chase & Co.	4 633 397	0	138 239 239
Clearstream	0	0	23 790 366
Total	8 916 758	1 490 689	1 127 463 560

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (*suite*)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund (en USD)	State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund (en USD)	State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund (en USD)
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	8 916 758	1 490 689	1 127 463 560
Total	8 916 758	1 490 689	1 127 463 560
	State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund (en EUR)	State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund (en USD)
Échéance restant à courir par type de transactions			
Revenu fixe	83 956 405	5 423 567	651 080
Obligations d'État	83 956 405	5 423 567	651 080
Total des garanties non numéraires	83 956 405	5 423 567	651 080
Ventilation par qualité*			
Notation > AA- (Valeur)	7 602 228	1 317 339	57 799
Notation < AA- (Valeur)	0	2 116	0
Qualité <i>non-investment grade</i>	76 354 177	4 104 112	593 281
Total	83 956 405	5 423 567	651 080
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres			
Inférieure à un mois	2 648 729	48 185	25 978
Une semaine à un mois	5 177 080	95 234	34 422
Un à trois mois	8 270 236	23 325	2 159
Trois mois à un an	24 277 949	499 446	139 143
Au-delà d'un an	43 582 411	4 757 377	449 378
Total	83 956 405	5 423 567	651 080
Compartiments par devise			
EUR	66 014 258	4 984 617	542 970
GBP	4 477 564	30 357	3 407
USD	13 464 583	408 593	104 703
Total	83 956 405	5 423 567	651 080
Montants par agent tripartite			
Triparty	83 956 405	5 423 567	651 080
Euroclear	80 981 422	4 959 452	651 080
Clearstream	2 974 983	464 115	0
Total	83 956 405	5 423 567	651 080
Montants détenus par un dépositaire			
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	83 956 405	5 423 567	651 080
Total	83 956 405	5 423 567	651 080

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)
Échéance restant à courir par type de transactions	
Revenu fixe	15 614 001
Obligations d'État	15 614 001
Total des garanties non numéraires	15 614 001
Ventilation par qualité*	
Notation > AA- (Valeur)	1 449 399
Qualité <i>non-investment grade</i>	14 164 602
Total	15 614 001
Échéance restant à courir par transactions de prêt de titres	
Inférieure à un mois	538 316
Une semaine à un mois	836 988
Un à trois mois	639 814
Trois mois à un an	4 494 255
Au-delà d'un an	9 104 628
Total	15 614 001
Compartiments par devise	
EUR	12 250 025
GBP	718 729
USD	2 645 247
Total	15 614 001
Montants par agent tripartite	
Triparty	15 614 001
Euroclear	14 520 035
Clearstream	1 093 966
Total	15 614 001
Montants détenus par un dépositaire	
State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	15 614 001
Total	15 614 001

Les garanties non numéraires accordées à la contrepartie au moyen de contrats de garantie sous forme de titres pour les transactions d'emprunts de marge/titres sont conservées dans un compte séparé.

Les garanties non numéraires ne sont ni réutilisées ni réinvesties.

Le tableau suivant fournit une analyse du rendement des transactions de prêt de titres au 31 décembre 2023 :

	pour le Compartiment*		pour la tierce partie	
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund (en EUR)	106 334	75 %	35 409	25 %
State Street EMU Government Bond Index Fund (en EUR)	20 179	75 %	6 678	25 %
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund (en EUR)	2 074	75 %	691	25 %
State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund (en EUR)	155 388	75 %	51 673	25 %
State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund (en EUR)	56 167	75 %	18 660	25 %
State Street Global Treasury Bond Index Fund (en USD)	528 883	75 %	176 136	25 %

Annexe IV – Opérations de financement sur titres (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

	pour le Compartiment*		pour la tierce partie	
State Street Global Aggregate Bond Index Fund (en USD)	989 665	75 %	329 631	25 %
State Street Japan Screened Index Equity Fund (en JPY)	15 532 599	75 %	5 167 308	25 %
State Street Switzerland Index Equity Fund (en CHF)	353 836	75 %	119 604	25 %
State Street UK Index Equity Fund (en GBP)	548	75 %	180	25 %
State Street US Screened Index Equity Fund (en USD)	49 218	75 %	16 392	25 %
State Street EMU Screened Index Equity Fund (en EUR)	40 062	75 %	13 323	25 %
State Street Europe Screened Index Equity Fund (en EUR)	230 194	75 %	76 673	25 %
State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund (en USD)	6 273	75 %	2 082	25 %
State Street World Screened Index Equity Fund (en USD)	1 061 706	75 %	353 646	25 %
State Street World ESG Index Equity Fund (en USD)	444 379	75 %	147 887	25 %
State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund (en USD)	72 397	75 %	24 073	25 %
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund (en EUR)	1 205	75 %	401	25 %
State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund (en USD)	85 125	75 %	28 318	25 %
State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund (en EUR)	132 124	75 %	44 013	25 %
State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	61 342	75 %	20 426	25 %
State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	17 740	75 %	5 856	25 %
State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund (en USD)	55 099	75 %	18 356	25 %
State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund (en USD)	126 672	75 %	42 192	25 %
State Street EMU ESG Screened Equity Fund (en EUR)	7 522	75 %	2 495	25 %
State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund (en EUR)	10 879	75 %	3 591	25 %
State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund (en USD)	11 790	75 %	3 926	25 %
State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund (en USD)	128 553	75 %	42 805	25 %
State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund (en USD)	48 392	75 %	16 122	25 %
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund (en USD)	1 015 106	75 %	338 220	25 %
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	83 253	75 %	27 740	25 %
State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund (en EUR)	11 745	75 %	3 904	25 %
State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund (en USD)	10 896	75 %	3 622	25 %
State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund (en USD)	19 829	75 %	6 597	25 %

* Les coûts du programme sont supportés par les revenus affectés à la tierce partie.

Annexe V – Politique de rémunération (non auditée)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

State Street Corporation (« SSC ») et ses filiales directes et indirectes (ci-après conjointement désignées avec SSC « State Street ») appliquent une stratégie de compensation à l'échelle du groupe, laquelle inclut une politique de rémunération applicable à toutes les entités de State Street dans le monde. State Street Global Advisors Europe Limited (« SSGAEL ») est la Société de gestion, le Gestionnaire financier et le Distributeur mondial de SSGA Luxembourg SICAV, et a délégué certaines activités de gestion des investissements et des risques à SSGA Limited, SSGA Singapore et SSGA Trust Company (conjointement, les « Gestionnaires financiers »). En tant que filiales de State Street, les Gestionnaires financiers sont entièrement intégrés dans la stratégie de compensation du groupe State Street et sont placés sous l'autorité de la structure de gouvernance mondiale et régionale de State Street afin d'assurer le contrôle adéquat et pertinent des modalités de rémunération (en ce compris la conformité aux règles de rémunération correspondantes) au sein des entités affiliées du groupe State Street. En vertu de sa charte, consultable sur demande, le Comité des ressources humaines (« CRH ») de SSC supervise l'ensemble des régimes, politiques et programmes de rémunération de State Street auxquels participent les cadres dirigeants, ainsi que les régimes d'intéressement, de retraite, de prévoyance et d'attribution d'actions du groupe auxquels participent certains autres employés de SSC. Il s'assure également que les conventions de rémunération par intéressement sont en adéquation avec la sécurité financière et la viabilité de State Street, conformément aux dispositions et orientations réglementaires applicables. Le CRH autorise la dotation globale du Plan d'intéressement (« PI »). Le PDG de State Street attribue les enveloppes du PI aux entités opérationnelles et aux services du groupe en fonction de divers facteurs, parmi lesquels la performance budgétaire, la réalisation d'objectifs clés et autres considérations. La dépense définitive et la dotation globale entre allocations immédiates et différées sont ensuite révisées par le CRH avant que le paiement soit effectué.

State Street a constitué un Comité de rémunération SSGAEL pour le Royaume-Uni, dont les fonctions principales sont les suivantes :

- Examiner la politique de rémunération applicable aux employés, aux dirigeants ainsi qu'au Personnel identifié de SSGAEL et en superviser la mise en œuvre ;
- Superviser le respect de toutes réglementations applicables en matière de rémunération ;
- Examiner et approuver les décisions de rémunération du Personnel identifié, et tenir compte des recommandations d'ajustement *ex post* du risque pour le Personnel identifié.

State Street applique une politique de rémunération à l'échelle mondiale qui s'appuie sur une documentation révisée annuellement (et complétée par tout addenda pertinent par territoire ou par régime de réglementation), laquelle documentation renseigne la grille de rémunération existante de State Street. Cette politique est conçue pour observer les contraintes réglementaires applicables à la rémunération, incluant notamment les dispositions prévues par les Directives CRD, OPCVM V et par la Directive AIFM relative aux gestionnaires de FIA, et sera interprétée et administrée en conséquence. Les politiques et pratiques de rémunération de State Street s'appliquent à tous les collaborateurs du groupe State Street dans le monde (en ce compris, les Gestionnaires financiers). Les principes directeurs qui permettent d'aligner le système de rémunération de State Street sur la stratégie opérationnelle sont les suivants :

- Nous privilégions la rémunération globale.
- Nous visons un Programme de rémunération globale d'une valeur totale annuelle qui rivalise avec nos homologues du secteur.
- Le financement de notre Programme de rémunération globale est subordonné aux conditions de faisabilité et conçu pour s'adapter à la performance du groupe.
- Nous soutenons sans équivoque la parité salariale pour un travail de même valeur.
- Nous différencions la rémunération basée sur la performance.
- Nous alignons les intérêts des collaborateurs sur ceux des Actionnaires.
- Nos régimes de rémunération sont conçus pour être conformes à la réglementation en vigueur et aux orientations correspondantes, et impliquent de ne pas encourager la prise de risques excessifs.

Étant donné notre processus d'appréciation structuré pour déterminer les enveloppes d'intéressement et les décisions d'allocations individuelles, de report des primes incitatives et des possibles ajustements *ex ante* et *ex post*, comme les renoncations et les récupérations fiscales, notre système de rémunération est raisonnablement sensible au risque et corrèle les décisions et mesures courantes avec les critères de risques futurs.

Annexe V – Politique de rémunération (non auditée) (suite)

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

State Street applique une politique de prime discrétionnaire et entièrement flexible (à savoir que le montant de la composante variable individuelle peut fluctuer de manière importante d'une année sur l'autre, en fonction de la performance et des autres facteurs susmentionnés, et peut même être réduit à zéro sur une année donnée). La politique de prime discrétionnaire est structurée de manière à équilibrer les composantes fixes et les composantes variables, mais inclut également des ratios de rémunération maximum spécifiques lorsque les réglementations locales le nécessitent. Un certain nombre de collaborateurs des services commerciaux participent aux Plans d'intéressement structurés, lesquels visent à ajuster la composante variable accordée aux participants des plans sur les revenus qu'ils génèrent, tout en tenant compte d'indicateurs de performance qualitative non financiers. Tous les participants perçoivent une composante fixe de rémunération suffisamment élevée. La composante variable est attribuée à titre individuel en fonction de facteurs quantitatifs aussi bien que qualitatifs.

Montant total de la rémunération payée par les Gestionnaires financiers au 31 décembre 2023¹

Rémunération fixe (en k€)	182 417
Rémunération variable (en k€)	154 813
Rémunération globale (en k€)	337 230
Nombre de bénéficiaires	1 448
Commission de performance directement versée par l'OPCVM	s/o

Montant total des rémunérations au 31 décembre 2023 (en k€)

Direction générale de SSGAEL ²	208
Personnel identifié des Gestionnaires financiers	187 866

De plus amples informations concernant l'approche de rémunération de State Street, incluant (mais pas seulement) les informations sur la procédure de prise de décision pour déterminer la politique de rémunération, ses principales caractéristiques et la relation entre la rémunération et la performance, sont publiées séparément dans la Déclaration de mandat de State Street sur le site www.statestreet.com et la partie sur la rémunération de la publication de UK Pillar 3 de SSGA Limited sur le site <https://www.ssga.com/library-content/pdfs/global/ssgal-pillar-3-disclosure-2023.pdf>. Compte tenu de la stratégie globale de rémunération du groupe State Street, les renseignements sur les critères qualitatifs de rémunération inclus dans le Rapport *UK Pillar 3* s'appliquent également aux employés de State Street basés hors du Royaume-Uni ainsi qu'aux employés des Gestionnaires financiers.

¹ Ces données sont basées sur la rémunération de l'ensemble du personnel des Gestionnaires financiers, le nombre de bénéficiaires étant indiqué. Les données sur la rémunération totale de 2023 ne sont pas disponibles au 31 décembre 2023 étant donné que la rémunération variable pour 2023 ne sera pas versée avant le premier trimestre de 2024. La rémunération fixe pour l'année de performance et les données de rémunération variable pour 2022 ont été fournies pour les bénéficiaires.

² Représente la rémunération versée aux administrateurs indépendants (les Administrateurs qui sont également employés de SSC ne perçoivent pas de rémunération en leur qualité de membres du Conseil d'administration).

Annexe VI – Informations à fournir en vertu du SFDR et du Règlement Taxinomie

pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023

Le Règlement de l'Union européenne (« UE ») sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (Règlement UE/2019/2088) (« SFDR ») impose que la SICAV State Street Global Advisors Luxembourg réponde aux exigences de transparence sur le mode d'intégration des considérations de durabilité dans le processus d'investissement de chacun des Compartiments. Le Règlement de l'UE sur l'établissement d'un cadre visant à favoriser les investissements durables (Règlement UE/2020/852) (le « Règlement Taxinomie ») exige que la SICAV State Street Global Advisors Luxembourg communique des informations supplémentaires pour chacun des Compartiments aux fins d'améliorer la transparence et de permettre une comparaison objective des produits financiers quant à la proportion des investissements de ces produits financiers qui contribuent à des activités économiques durables sur le plan environnemental, sachant que le champ des activités économiques durables sur le plan environnemental, tel que prescrit dans le Règlement Taxinomie, est plus restreint que le champ des investissements durables prévu par le SFDR. Veuillez consulter le Supplément pertinent concernant les informations à fournir pour chaque Compartiment en application du SFDR et du Règlement Taxinomie.

Compartiments relevant de la définition de produits financiers au sens de l'Article 6 du SFDR

Les Compartiments

State Street Asia Pacific Value Spotlight Fund,
State Street Canada Index Equity Fund,
State Street China Opportunities Equity Fund,
State Street Emerging Market Hard Currency Government Bond Index Fund,
State Street Emerging Markets Local Currency Government Bond Index Fund,
State Street Emerging Markets Opportunities Equity Fund,
State Street EMU Government Bond Index Fund,
State Street Euro Core Treasury Bond Index Fund,
State Street Euro Inflation Linked Bond Index Fund,
State Street Europe Value Spotlight Fund,
State Street Eurozone Value Spotlight Fund,
State Street Flexible Asset Allocation Plus Fund,
State Street Global Aggregate Bond Index Fund,
State Street Global Opportunities Equity Fund,
State Street Global Treasury 1-10 Year Bond Index Fund,
State Street Global Treasury Bond Index Fund,
State Street Global Value Spotlight Fund,
State Street Switzerland Index Equity Fund,
State Street UK Index Equity Fund,
State Street US Opportunities Equity Fund,
State Street US Value Spotlight Fund,

présentent chacun des investissements sous-jacents qui ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund

Identifiant d'entité juridique : BGDNR0UF4DXP46WRG43

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%



Non



Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street Euro Corporate Bond Screened Index Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à un filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le Compartiment peut utiliser des techniques de filtrage ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure des titres d'émetteurs sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs de ces critères ESG.

L'écart de performance sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,25 %. L'écart de performance de 25 pb résulte de l'efficacité des techniques d'échantillonnage et de négociation grâce à une série de rachats tout au long de l'exercice. Le Compartiment a également surperformé son indice du fait de la sélection de titres établie à partir de la méthode d'échantillonnage utilisée.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée au moyen des exclusions appliquées par le portefeuille concerné et listées dans la question précédente. Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BNP PARIBAS	BANQUE	1,66 %	FRANCE
BANQUE FED CRED MUTUEL	BANQUE	1,65 %	FRANCE
CREDIT AGRICOLE SA	BANQUE	1,19 %	FRANCE
BPCE SA	BANQUE	1,16 %	FRANCE
VOLKSWAGEN INTL FIN NV	CONSOMMATION CYCLIQUE	1,16 %	PAYS-BAS
SOCIETE GENERALE	BANQUE	1,08 %	FRANCE
ING GROEP NV	BANQUE	1,07 %	PAYS-BAS
BANCO SANTANDER SA	BANQUE	0,90 %	ESPAGNE
ORANGE SA	COMMUNICATION	0,84 %	FRANCE
ENGIE SA	GAZ NATUREL	0,84 %	FRANCE
CAIXABANK SA	BANQUE	0,82 %	ESPAGNE
DEUTSCHE BANK AG	BANQUE	0,82 %	ALLEMAGNE
MORGAN STANLEY	BANQUE	0,79 %	ÉTATS-UNIS
ENI SPA	ÉNERGIE	0,74 %	ITALIE
ABN AMRO BANK NV	BANQUE	0,72 %	PAYS-BAS

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

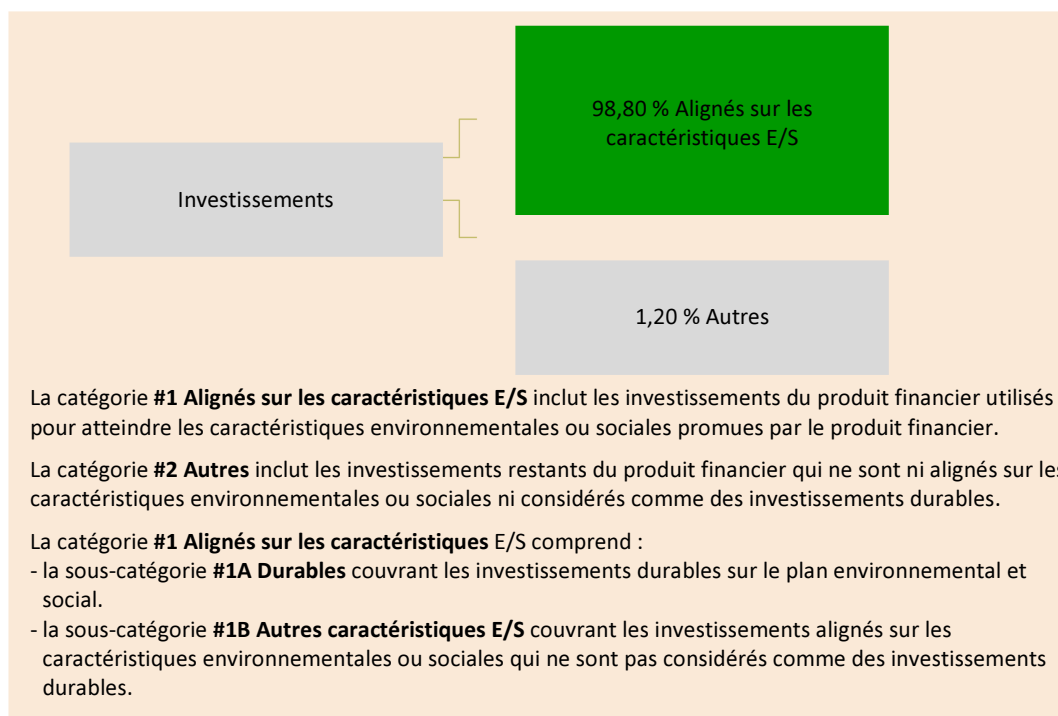
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.



- **Quelle était l'allocation des actifs ?**

98,80 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,20 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

BANQUE	31,18 %
BANQUE	31,18 %
CONSOMMATION NON CYCLIQUE	13,60 %
ALIMENTATION ET BOISSONS	4,83 %
SANTÉ	3,27 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	2,57 %
PRODUITS DE CONSOMMATION	1,53 %
TABAC	0,80 %
SUPERMARCHÉS	0,60 %
CONSOMMATION CYCLIQUE	8,87 %
AUTOMOBILE	6,23 %
SERVICES DE CONSOMMATION CYCLIQUE	1,38 %
COMMERCE DE DÉTAIL	0,91 %
RESTAURANTS	0,29 %
HÉBERGEMENT	0,07 %
COMMUNICATION	6,82 %
LIGNES FILAIRES	4,27 %
MÉDIAS ET LOISIRS	1,16 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

LIGNES SANS FIL	1,04 %
CÂBLE ET SATELLITE	0,35 %
BIENS D'ÉQUIPEMENT	5,16 %
INDUSTRIE MANUFACTURIÈRE DIVERSIFIÉE	2,77 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	1,62 %
MACHINES DE CONSTRUCTION	0,47 %
EMBALLAGES	0,23 %
ENVIRONNEMENT	0,07 %
ASSURANCE	4,64 %
ASSURANCE VIE	3,14 %
DOMMAGES ET RESPONSABILITÉ CIVILE	1,41 %
ASSURANCE SANTÉ	0,09 %
ÉLECTRICITÉ	4,49 %
ÉLECTRICITÉ	4,49 %
ÉNERGIE	3,82 %
INTÉGRÉE	3,44 %
SERVICES PÉTROLIERS	0,15 %
INDÉPENDANTE	0,15 %
RAFFINERIES	0,05 %
SECTEUR INTERMÉDIAIRE	0,04 %
TRANSPORTS	3,38 %
SERVICES DE TRANSPORT	3,10 %
CHEMINS DE FER	0,16 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,13 %
TECHNOLOGIE	3,36 %
TECHNOLOGIE	3,36 %
REIT	3,04 %
REIT – AUTRES	1,30 %
REIT – DÉTAIL	1,13 %
REIT – BUREAUX	0,57 %
REIT – ÉTABLISSEMENTS DE SANTÉ	0,04 %
FINANCE – AUTRES	3,02 %
FINANCE – AUTRES	3,02 %
INDUSTRIE DE BASE	2,92 %
PRODUITS CHIMIQUES	2,22 %
MÉTAUX ET INDUSTRIE MINIÈRE	0,40 %
PAPIER	0,30 %
GAZ NATUREL	2,29 %
GAZ NATUREL	2,29 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	1,01 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	1,01 %
SERVICES PUBLICS – AUTRES	0,85 %

SERVICES PUBLICS – AUTRES	0,85 %
INDUSTRIE – AUTRES	0,33 %
INDUSTRIE – AUTRES	0,33 %
ACTIFS NON GARANTIS	0,31 %
ACTIFS NON GARANTIS	0,31 %
SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	0,26 %
SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	0,26 %
BONS DU TRÉSOR	0,09 %
BONS DU TRÉSOR	0,09 %
AUTORITÉS LOCALES	0,03 %
AUTORITÉS LOCALES	0,03 %
Finance	0,03 %
Immobilier	0,02 %
REIT	0,01 %
Services financiers divers	0,02 %
Prêts financiers automobiles	0,02 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

En gaz fossile En énergie nucléaire

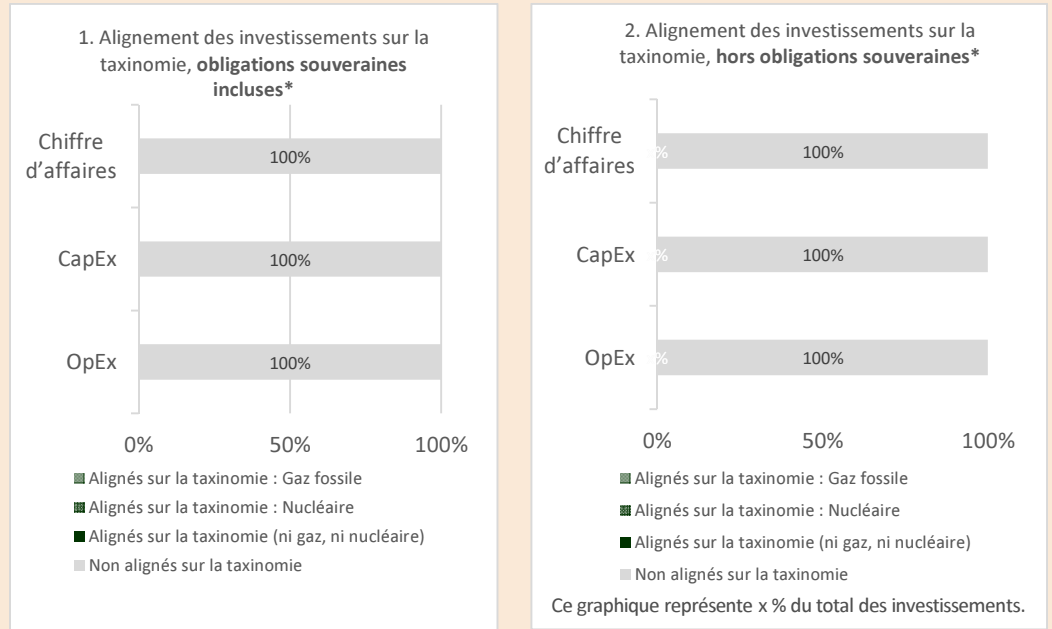
Non

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**


Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.

● **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,20 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indicel qui réplique la performance de l'indice Euro Aggregate Corporate Index en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice tout en excluant les titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG.

Les titres du Compartiment sont sélectionnés principalement parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres sont exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment éliminera les titres d'émetteurs identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées. Le Compartiment peut utiliser des techniques d'examen ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure les titres d'émetteurs sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs des critères ESG mentionnés dans la phrase précédente.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance est mise en œuvre via le filtrage négatif appliqué par le Compartiment. Les entreprises que le Gestionnaire financier juge ne pas contrevenir aux principes du Pacte mondial des Nations unies sont considérées faire preuve de bonne gouvernance.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund

Identifiant d'entité juridique : 5493004EVBREZGIHMC71

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques **qui sont considérées comme durables** sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : _____%

Non

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il **promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street SRI Euro Corporate Bond Index Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice Markit iBoxx Euro Sustainable Corporate Bond Custom Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment et plus spécifiquement, à l'approche d'optimisation (*Overlay*) de l'Investissement durable et responsable (ISR) utilisée dans la construction de l'Indice.



Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

L'écart de performance sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,28 %. Le Compartiment a bénéficié de l'efficacité des techniques d'échantillonnage et de négociation grâce à une série de rachats tout au long de l'exercice. Le Compartiment a surperformé son indice de 28 pb du fait de la sélection de titres établie à partir de la méthode d'échantillonnage utilisée.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée via la part du portefeuille du Compartiment investie dans des titres composant l'Indice.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?



La liste comprend les investissements constituant la **plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BNP PARIBAS	BANQUE	2,08 %	FRANCE
BANQUE FED CRED MUTUEL	BANQUE	1,46 %	FRANCE
BPCE SA	BANQUE	1,44 %	FRANCE
SOCIETE GENERALE	BANQUE	1,32 %	FRANCE
ING GROEP NV	BANQUE	1,30 %	PAYS-BAS
CREDIT AGRICOLE SA	BANQUE	1,18 %	FRANCE
BANCO SANTANDER SA	BANQUE	1,16 %	ESPAGNE
ORANGE SA	COMMUNICATION	1,10 %	FRANCE
MORGAN STANLEY	BANQUE	0,96 %	ÉTATS-UNIS
CAIXABANK SA	BANQUE	0,91 %	ESPAGNE
DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	ACTIFS NON GARANTIS	0,87 %	ALLEMAGNE
ABN AMRO BANK NV	BANQUE	0,86 %	PAYS-BAS
GOLDMAN SACHS GROUP INC	BANQUE	0,86 %	ÉTATS-UNIS
ANHEUSER BUSCH INBEV SA	CONSOMMATION NON CYCLIQUE	0,85 %	BELGIQUE
ENI SPA	ÉNERGIE	0,83 %	ITALIE

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs

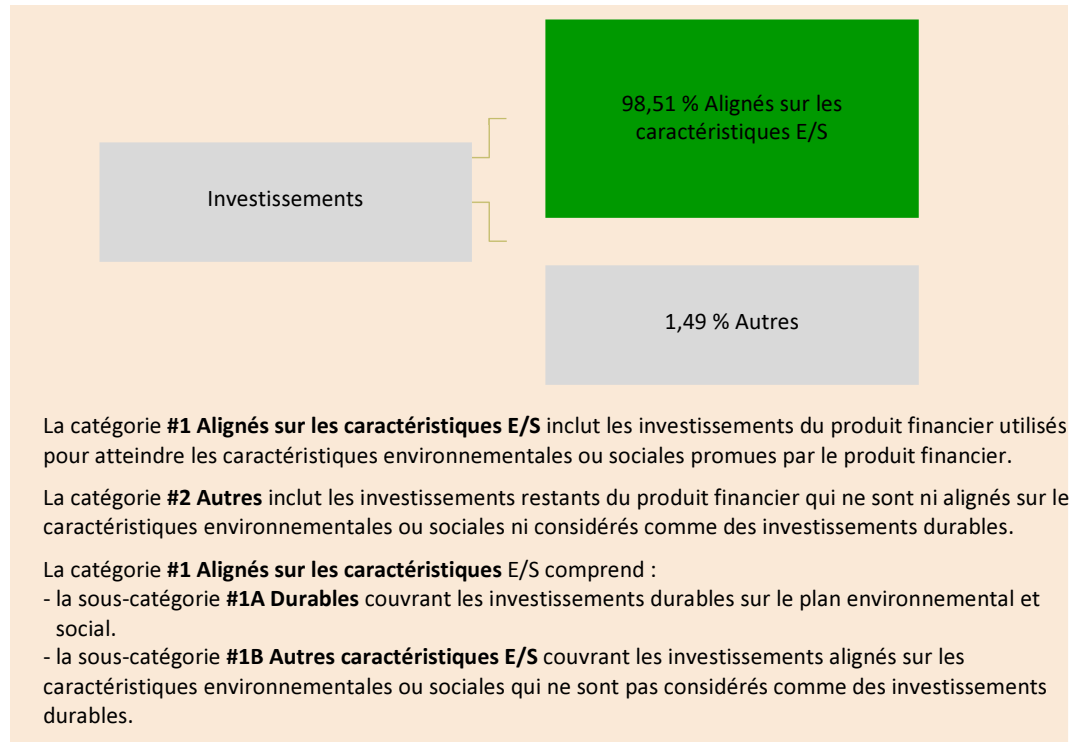
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?



Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

98,51 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,49 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

BANQUE	31,95 %
BANQUE	31,95 %
CONSOMMATION NON CYCLIQUE	11,30 %
ALIMENTATION ET BOISSONS	5,36 %
SANTÉ	1,90 %
PRODUITS DE CONSOMMATION	1,75 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	1,75 %
SUPERMARCHÉS	0,54 %
COMMUNICATION	7,90 %
LIGNES FILAIRES	4,97 %
MÉDIAS ET LOISIRS	1,36 %
LIGNES SANS FIL	1,14 %
CÂBLE ET SATELLITE	0,43 %
ACTIFS NON GARANTIS	6,42 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

ACTIFS NON GARANTIS	6,42 %
CONSUMMATION CYCLIQUE	5,37 %
AUTOMOBILE	2,78 %
SERVICES DE CONSOMMATION CYCLIQUE	1,25 %
COMMERCE DE DÉTAIL	0,98 %
RESTAURANTS	0,31 %
HÉBERGEMENT	0,04 %
ÉLECTRICITÉ	5,12 %
ÉLECTRICITÉ	5,12 %
ASSURANCE	4,89 %
ASSURANCE VIE	3,42 %
DOMMAGES ET RESPONSABILITÉ CIVILE	1,34 %
ASSURANCE SANTÉ	0,13 %
TRANSPORTS	3,74 %
SERVICES DE TRANSPORT	3,48 %
CHEMINS DE FER	0,14 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,12 %
TECHNOLOGIE	3,27 %
TECHNOLOGIE	3,27 %
FINANCE – AUTRES	3,09 %
FINANCE – AUTRES	3,09 %
BIENS D'ÉQUIPEMENT	3,02 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	1,33 %
INDUSTRIE MANUFACTURIÈRE DIVERSIFIÉE	1,07 %
MACHINES DE CONSTRUCTION	0,34 %
EMBALLAGES	0,20 %
ENVIRONNEMENT	0,07 %
REIT	2,89 %
REIT – DÉTAIL	1,12 %
REIT – AUTRES	1,05 %
REIT – BUREAUX	0,71 %
REIT – ÉTABLISSEMENTS DE SANTÉ	0,01 %
ÉNERGIE	2,78 %
INTÉGRÉE	2,33 %
SERVICES PÉTROLIERS	0,23 %
INDÉPENDANTE	0,15 %
RAFFINERIES	0,03 %
SECTEUR INTERMÉDIAIRE	0,03 %
INDUSTRIE DE BASE	2,47 %
PRODUITS CHIMIQUES	2,00 %
PAPIER	0,26 %
MÉTAUX ET INDUSTRIE MINIÈRE	0,22 %

AUTORITÉS LOCALES	1,63 %
AUTORITÉS LOCALES	1,63 %
GAZ NATUREL	1,33 %
GAZ NATUREL	1,33 %
SERVICES PUBLICS – AUTRES	0,86 %
SERVICES PUBLICS – AUTRES	0,86 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	0,81 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	0,81 %
INDUSTRIE – AUTRES	0,25 %
INDUSTRIE – AUTRES	0,25 %
SUBVENTIONNÉS PAR L'ÉTAT	0,23 %
SUBVENTIONNÉS PAR L'ÉTAT	0,23 %
BONS DU TRÉSOR	0,16 %
BONS DU TRÉSOR	0,16 %
SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	0,06 %
SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	0,06 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie.

● Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

En gaz fossile En énergie nucléaire

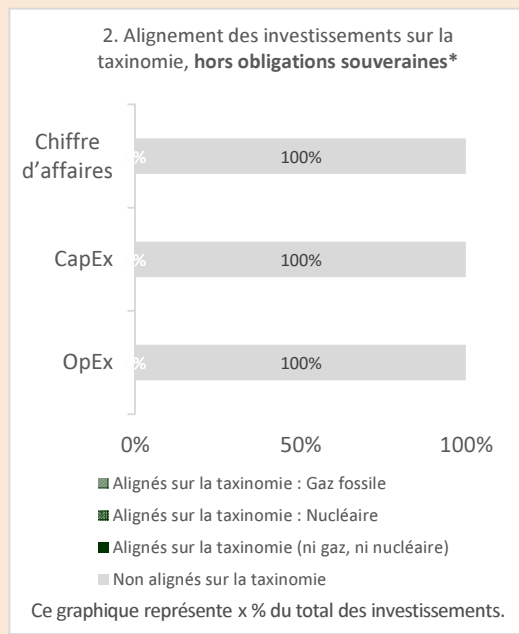
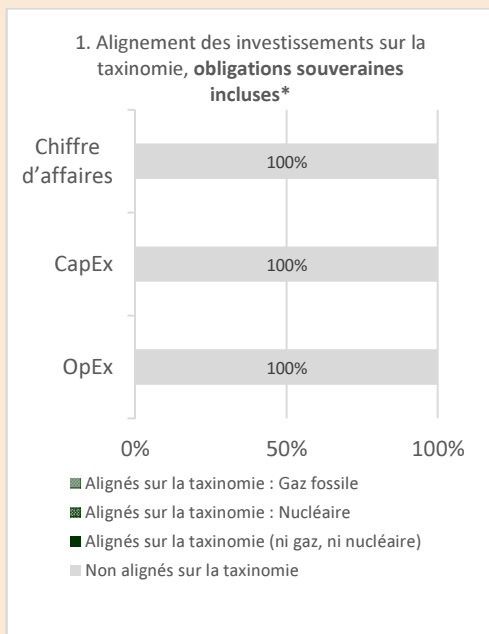
Non

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



● **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,49 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice Markit iBoxx Euro Sustainable Corporate Bond Custom Index. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre une approche d'optimisation (Overlay) de l'Investissement durable et responsable (« ISR »).

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. L'Indice mesure la performance du marché des obligations d'entreprise en euros, sélectionnées sur la base de critères de durabilité. L'Indice applique une approche Overlay ISR pour se construire et éliminer les émetteurs en fonction des normes mondiales, des controverses, de l'implication des produits et des notations de risque ESG.

L'Indice est révisé et rééquilibré tous les mois, le dernier jour ouvrable de chaque mois. L'Overlay ISR est réexaminé tous les semestres, lors des rééquilibrages de fin de mois, en mars et septembre.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers l'overlay d'ISR appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice Markit iBoxx Euro Sustainable Corporate Bond Custom Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 8,43 % sur une base brute de commissions et surperformé de 28 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 8,16 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 8,16 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. Le Compartiment a bénéficié de l'efficacité des techniques d'échantillonnage et de négociation. Bien que la surperformance du Compartiment soit majoritairement attribuable à l'échantillonnage, le reste résulte de l'efficacité de nos techniques de transaction et de valorisation.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indiciaire de l'indice Markit iBoxx qui peut être consulté sur le lien suivant :

Indices Web (ihsmarkit.com)

● **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice mesure la performance du marché des obligations d'entreprise en euros, sélectionnées sur la base de critères de durabilité. Les titres doivent être à taux fixe, libellés en euros et notés *investment grade*, comme le stipule la méthodologie de l'Indice. L'Indice de marché large utilisé ici est l'indice Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

L'Indice est révisé et rééquilibré tous les mois, le dernier jour ouvrable de chaque mois.

L'Overlay ISR est réexaminé tous les semestres, lors des rééquilibrages de fin de mois, en mars et septembre.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. L'Indice mesure la performance du marché des obligations d'entreprise en euros, sélectionnées sur la base de critères de durabilité. L'Indice applique une approche Overlay ISR pour se construire et éliminer les émetteurs en fonction des normes mondiales, des controverses, de l'implication des produits et des notations de risque ESG.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice Markit iBoxx Euro Sustainable Corporate Bond Custom Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 8,43 % sur une base brute de commissions et surperformé de 28 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 8,16 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 8,16 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. Le Compartiment a bénéficié de l'efficacité des techniques d'échantillonnage et de négociation. Bien que la surperformance du Compartiment soit majoritairement attribuable à l'échantillonnage, le reste résulte de l'efficacité de nos techniques de transaction et de valorisation.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 8,43 % sur une base brute de commissions et sous-performé de 0,24 % le rendement de l'indice de marché large établi à 8,19 %.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Index Fund

Identifiant d'entité juridique : 5493001XUAOLYG4Z1216

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : % <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables. <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social <input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street Emerging Markets ESG Local Currency Government Bond Fund est un fonds indicel qui réplique la performance de l'indice J.P. Morgan ESG-Government Bond Index Emerging Markets Global Diversified (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment et plus spécifiquement, aux scores ESG J.P. Morgan des émetteurs (« JESG ») qui sont utilisés dans la construction de l'Indice.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

L'écart de performance sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,14 %. La surperformance provient principalement de la sélection de titres, de l'exposition aux contrats à terme sur l'EGP et des plus-values intrajournalières.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée via la part du portefeuille du Compartiment investie dans des titres composant l'Indice.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- Les émissions de gaz à effet de serre des pays d'investissement
- Les pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
MEX BONOS DESARR FIX RT	BONS DU TRÉSOR	9,49 %	MEXIQUE
POLAND GOVERNMENT BOND	BONS DU TRÉSOR	9,32 %	POLOGNE
THAILAND GOVERNMENT BOND	BONS DU TRÉSOR	9,27 %	THAÏLANDE
INDONESIA GOVERNMENT	BONS DU TRÉSOR	8,73 %	INDONÉSIE
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	BONS DU TRÉSOR	8,26 %	AFRIQUE DU SUD
CZECH REPUBLIC	BONS DU TRÉSOR	8,25 %	RÉPUBLIQUE TCHÈQUE
CHINA GOVERNMENT BOND	BONS DU TRÉSOR	5,90 %	CHINE
MALAYSIA GOVERNMENT	BONS DU TRÉSOR	5,55 %	MALAISIE
LETRA TESOURO NACIONAL	BONS DU TRÉSOR	5,30 %	BRÉSIL
ROMANIA GOVERNMENT BOND	BONS DU TRÉSOR	4,61 %	ROUMANIE
HUNGARY GOVERNMENT BOND	BONS DU TRÉSOR	4,41 %	HONGRIE
NOTA DO TESOURO NACIONAL	BONS DU TRÉSOR	4,26 %	BRÉSIL
MALAYSIA INVESTMNT ISSUE	BONS DU TRÉSOR	4,16 %	MALAISIE
TITULOS DE TESORERIA	BONS DU TRÉSOR	4,04 %	COLOMBIE
BONOS TESORERIA PESOS	BONS DU TRÉSOR	2,65 %	CHILI

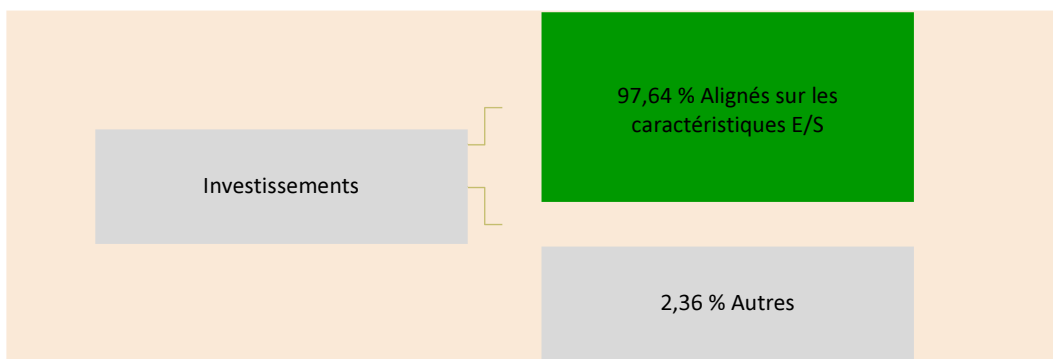
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

97,64 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 2,36 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

BONS DU TRÉSOR	98,95 %
ACTIFS NON GARANTIS	0,12 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

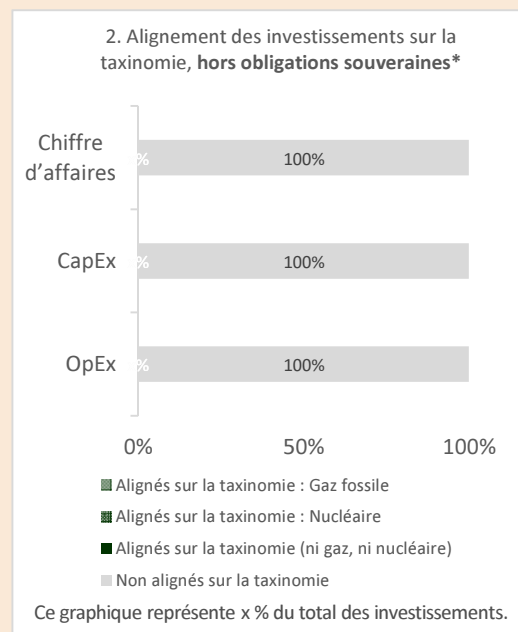
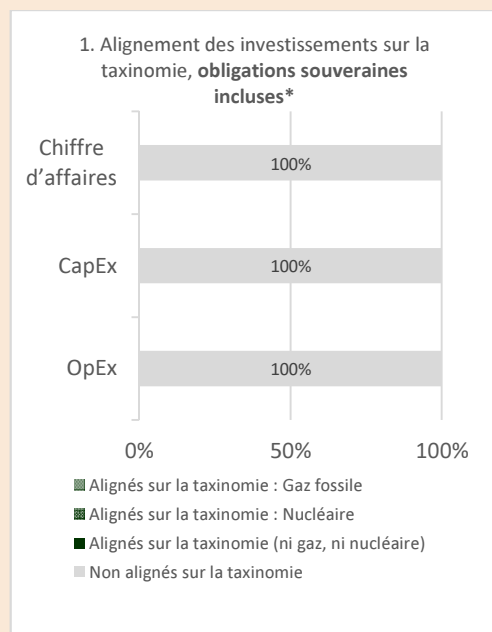
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
 - En gaz fossile
 - En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 2,36 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indicel qui réplique la performance de l'indice J.P. Morgan ESG-Government Bond Index Emerging Markets Global Diversified. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.

L'Indice applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG qui utilise les scores émetteurs JESG afin d'orienter ses composantes sur les émetteurs les mieux classés en fonction des critères ESG et des émissions d'obligations vertes, et de sous-pondérer et retirer les émetteurs moins bien classés.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. L'Indice mesure la performance des obligations d'État des marchés émergents en devise locale investissable. L'Indice applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG qui utilise

les scores émetteurs JESG afin d'orienter ses composantes sur les émetteurs les mieux classés en fonction des critères ESG et des émissions d'obligations vertes, et de sous-pondérer et retirer les émetteurs moins bien classés.

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision constante ainsi qu'un rééquilibrage le dernier jour ouvrable du mois aux États-Unis.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance ne s'applique pas aux obligations d'État conformément aux « Questions relatives au Règlement (UE) 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR) » de la Commission européenne publiées le 25 mai 2022.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?



L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice J.P. Morgan ESG-Government Bond Index Emerging Markets Global Diversified aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 14,21 % sur une base brute de commissions et surperformé de 14 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 14,06 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 14,01 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance provient principalement de la sélection de titres, de l'exposition aux contrats à terme sur l'EGP et des plus-values intrajournalières.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer à la méthodologie de l'indice Morgan ESG GBI-EM Global Diversified Index :

<https://www.jpmorgan.com/country/US/en/jpmorgan/investbk/solutions/research/indices/product>

● En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?

L'Indice est basé sur son indice parent, le J.P. Morgan Government Bond Index – Emerging Markets Global Diversified, lequel couvre la performance des obligations souveraines des marchés émergents libellées en monnaie locale. L'Indice désigné du Compartiment (le J.P. Morgan ESG-Government Bond Index Emerging Markets Global Diversified) représente la performance de l'ensemble des obligations investissables des marchés émergents en monnaie locale, sélectionnées sur la base de critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG).

● Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision constante ainsi qu'un rééquilibrage le dernier jour ouvrable du mois aux États-Unis.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. L'Indice mesure la performance des obligations d'État des marchés émergents en devise locale investissable. L'Indice applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG qui utilise les scores émetteurs JESG afin d'orienter ses composantes sur les émetteurs les mieux classés en fonction des critères ESG et des émissions d'obligations vertes, et de sous-pondérer et retirer les émetteurs moins bien classés.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice J.P. Morgan ESG-Government Bond Index Emerging Markets Global Diversified au moyen de la Stratégie d'échantillonnage stratifié, aussi étroitement que possible, tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 14,21 % sur une base brute de commissions et surperformé de 14 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 14,06 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de -14,01 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance provient principalement de la sélection de titres, de l'exposition aux contrats à terme sur l'EGP et des plus-values intrajournalières.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 14,21 % sur une base brute de commissions et surperformé de 1,51 % le rendement de l'indice de marché large établi à 12,70 %.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300WNYUYK9I10ZX34

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : _____%

Non

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il **promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street Global High Yield Bond Screened Index Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice ICE BofA Global High Yield Constrained Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à un filtre négatif et basé sur des normes pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le Compartiment peut utiliser des techniques d'examen ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure des titres d'émetteurs sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs de ces critères ESG.

La liste spécifique des exclusions applicables peut évoluer et peut être modifiée le cas échéant, à l'entière discrétion du Gestionnaire financier. Ces changements peuvent être appliqués sans notification préalable aux Actionnaires dès lors qu'ils sont réputés conformes aux critères de filtrage décrits dans cette section.

L'écart de performance sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,40 %. Le Compartiment est de petite taille au regard de son exposition sous-jacente. En outre, le portefeuille a beaucoup recours à l'échantillonnage en raison des filtres ESG POV, ce qui génère des sous-pondérations importantes de certains émetteurs qui doivent être compensées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée au moyen des exclusions appliquées par le portefeuille concerné et listées dans la question précédente. Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	COMMUNICATION	1,23 %	ÉTATS-UNIS
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	CONSOMMATION CYCLIQUE	1,07 %	ÉTATS-UNIS
TENET HEALTHCARE CORP	CONSOMMATION NON CYCLIQUE	0,76 %	ÉTATS-UNIS
PETROBRAS GLOBAL FINANCE	SUBVENTIONNÉS PAR L'ÉTAT	0,68 %	BRÉSIL
TRANSDIGM INC	BIENS D'ÉQUIPEMENT	0,67 %	ÉTATS-UNIS
SOFTBANK GROUP CORP	COMMUNICATION	0,66 %	JAPON
CARNIVAL CORP	CONSOMMATION CYCLIQUE	0,61 %	PANAMA
ELECTRICITE DE FRANCE SA	Services publics	0,59 %	FRANCE
ECOPETROL SA	ÉNERGIE	0,57 %	COLOMBIE
CSC HOLDINGS LLC	COMMUNICATION	0,55 %	ÉTATS-UNIS
ALTICE FRANCE SA	COMMUNICATION	0,53 %	FRANCE
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	CONSOMMATION NON CYCLIQUE	0,50 %	ÉTATS-UNIS
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	CONSOMMATION CYCLIQUE	0,50 %	LIBERIA
TELECOM ITALIA SPA	COMMUNICATION	0,46 %	ITALIE
DISH DBS CORP	COMMUNICATION	0,45 %	ÉTATS-UNIS

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.



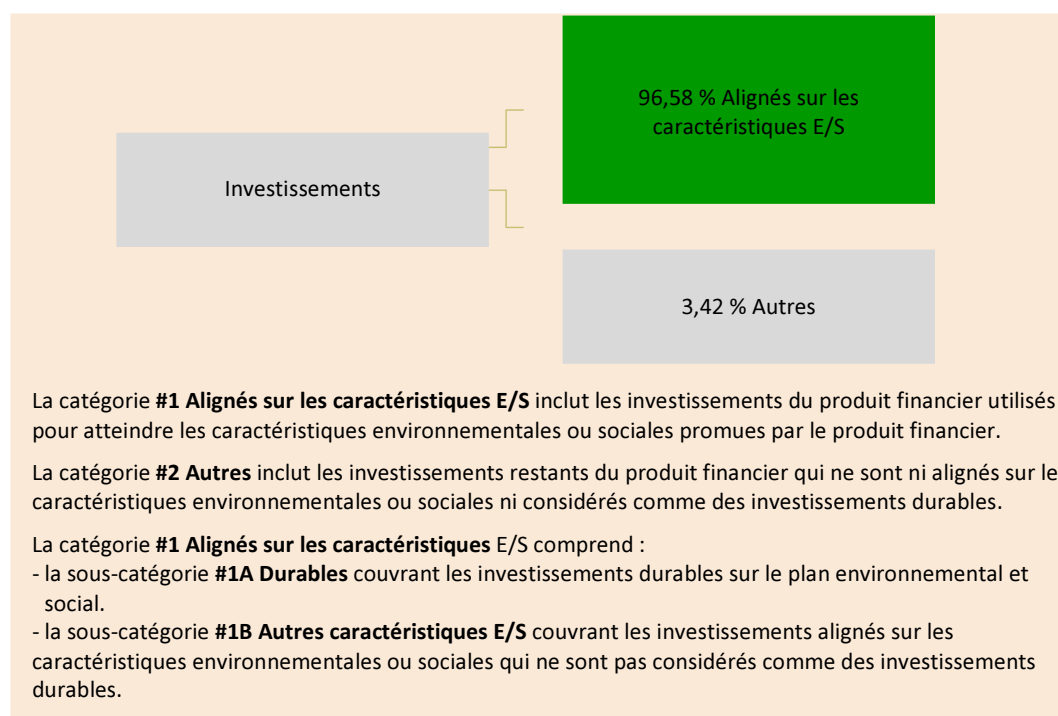
Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

96,58 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 3,42 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

CONSUMMATION CYCLIQUE	19,60 %
AUTOMOBILE	4,58 %
SERVICES DE CONSOMMATION CYCLIQUE	2,72 %
COMMERCE DE DÉTAIL	2,70 %
JEUX D'ARGENT	2,63 %
LOISIRS	2,51 %
RESTAURANTS	0,93 %
HÉBERGEMENT	0,86 %
CONSTRUCTION DE LOGEMENTS	0,74 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,45 %
Commerce de détail	0,44 %
Constructeurs automobiles	0,35 %
Divertissements	0,21 %
Équipement et pièces détachées automobiles	0,13 %
Loisirs	0,13 %
Articles ménagers	0,05 %

Restauration	0,05 %
Accessoires d'ameublement	0,04 %
Distribution/gros	0,03 %
Constructeurs de logements	0,02 %
Textiles	0,01 %
COMMUNICATION	14,97 %
CÂBLE ET SATELLITE	4,94 %
LIGNES FILAIRES	3,22 %
LIGNES SANS FIL	2,56 %
MÉDIAS ET LOISIRS	2,41 %
Télécommunications	1,24 %
Médias	0,38 %
Internet	0,20 %
Publicité	0,01 %
ÉNERGIE	11,58 %
SECTEUR INTERMÉDIAIRE	3,55 %
INDÉPENDANTE	3,09 %
Pétrole et gaz	2,30 %
SERVICES PÉTROLIERS	1,26 %
Sources d'énergie alternatives	0,49 %
Pipelines	0,45 %
RAFFINERIES	0,37 %
Services - Pétrole et gaz	0,06 %
INTÉGRÉE	0,00 %
CONSOMMATION NON CYCLIQUE	10,69 %
SANTÉ	4,05 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	1,70 %
ALIMENTATION ET BOISSONS	1,55 %
PRODUITS DE CONSOMMATION	1,30 %
SUPERMARCHÉS	0,85 %
Alimentation	0,46 %
Services commerciaux	0,41 %
Services - Soins de santé	0,12 %
Agriculture	0,11 %
Boissons	0,08 %
Soins cosmétiques et personnels	0,06 %
Produits/Articles domestiques	0,01 %
BIENS D'ÉQUIPEMENT	7,98 %
EMBALLAGES	2,22 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	1,61 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	1,50 %
INDUSTRIE MANUFACTURIÈRE DIVERSIFIÉE	1,28 %

MACHINES DE CONSTRUCTION	0,79 %
ENVIRONNEMENT	0,59 %
TECHNOLOGIE	5,04 %
TECHNOLOGIE	4,81 %
Ordinateurs	0,14 %
Semi-conducteurs	0,06 %
Logiciels	0,03 %
Équipement de bureau/d'entreprise	0,00 %
INDUSTRIE DE BASE	4,11 %
PRODUITS CHIMIQUES	2,25 %
MÉTAUX ET INDUSTRIE MINIÈRE	1,42 %
PAPIER	0,44 %
Finance	3,47 %
Banques	1,90 %
Immobilier	0,76 %
Services financiers divers	0,46 %
REIT	0,15 %
Assurance	0,12 %
Sociétés d'investissement	0,07 %
Capital-investissement	0,02 %
BANQUE	3,20 %
BANQUE	3,20 %
TRANSPORTS	2,42 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	1,32 %
SERVICES DE TRANSPORT	1,02 %
CHEMINS DE FER	0,08 %
ÉLECTRICITÉ	1,94 %
ÉLECTRICITÉ	1,94 %
SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	1,87 %
SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	1,87 %
Services publics	1,72 %
ÉLECTRICITÉ	1,61 %
Gaz	0,08 %
Eau	0,03 %
FINANCE – AUTRES	1,69 %
FINANCE – AUTRES	1,69 %
Industrie	1,55 %
Transports	0,36 %
Ingénierie et construction	0,34 %
Matériaux de construction	0,33 %
Emballage - Conteneurs	0,22 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,17 %

Contrôle environnemental	0,05 %
Outils manuels/Machines outils	0,04 %
Transport routier et crédit-bail	0,02 %
Divers industrie	0,01 %
Produits électroniques	0,01 %
Divers machinerie	0,01 %
Matériaux de base	1,51 %
Exploitation minière	0,73 %
PRODUITS CHIMIQUES	0,42 %
Industrie sidérurgique	0,35 %
Produits forestiers et papier	0,02 %
REIT	1,40 %
REIT – AUTRES	0,85 %
REIT – ÉTABLISSEMENTS DE SANTÉ	0,35 %
REIT – BUREAUX	0,11 %
REIT – DÉTAIL	0,09 %
INDUSTRIE – AUTRES	1,22 %
INDUSTRIE – AUTRES	1,22 %
ASSURANCE	1,19 %
DOMMAGES ET RESPONSABILITÉ CIVILE	0,96 %
ASSURANCE VIE	0,13 %
ASSURANCE SANTÉ	0,09 %
SUBVENTIONNÉS PAR L'ÉTAT	0,68 %
SUBVENTIONNÉS PAR L'ÉTAT	0,68 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	0,65 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	0,65 %
ACTIFS NON GARANTIS	0,46 %
ACTIFS NON GARANTIS	0,46 %
SERVICES PUBLICS – AUTRES	0,18 %
SERVICES PUBLICS – AUTRES	0,18 %
GAZ NATUREL	0,11 %
GAZ NATUREL	0,11 %
État	0,07 %
SOUVERAINS	0,07 %
Divers	0,03 %
Sociétés holding – Divers	0,03 %



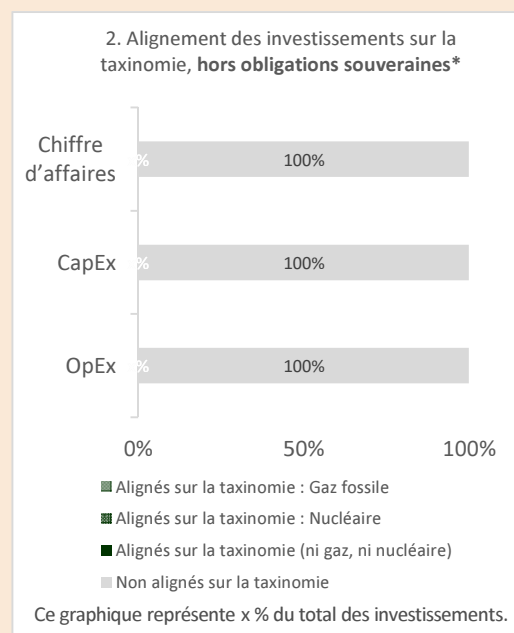
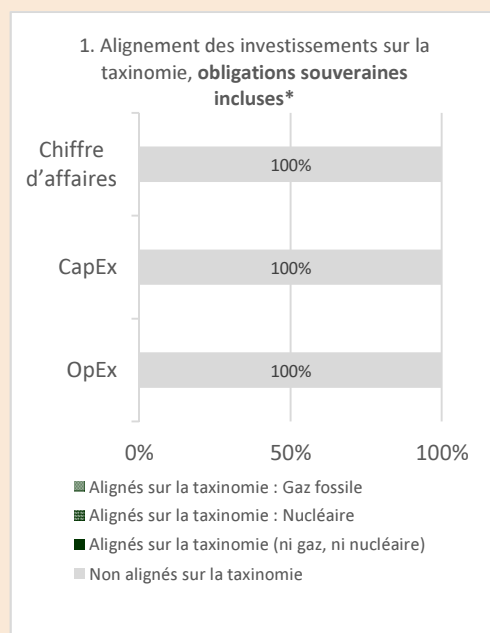
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie.

● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
 - En gaz fossile
 - En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 3,42 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice ICE BofA Global High Yield Constrained Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance entre la performance du Compartiment et celle de l'Indice tout en excluant des titres sur la base de l'évaluation de leur conformité aux critères ESG, c'est-à-dire aux normes internationales en matière de protection environnementale, de droits de l'homme, de normes de travail et anti-corruption, et concernant le tabac et les armes controversées.

Les titres du Compartiment sont sélectionnés principalement parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres sont exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment éliminera les titres d'émetteurs identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que le tabac et les armes controversées. Le Compartiment peut utiliser des techniques d'examen ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure les titres d'émetteurs sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs des critères ESG mentionnés dans la phrase précédente.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance est mise en œuvre via le filtrage négatif appliqué par le Compartiment. Les entreprises que le Gestionnaire financier juge ne pas contrevenir aux principes du Pacte mondial des Nations unies sont considérées faire preuve de bonne gouvernance.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?



Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Index Fund

Identifiant d'entité juridique : 984500B59FHT702E1167

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de __ % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social :	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street Emerging Markets ESG Hard Currency Government Bond Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment et plus spécifiquement, aux scores ESG J.P. Morgan des émetteurs (« JESG ») qui sont utilisés dans la construction de l'Indice.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée via la part du portefeuille du Compartiment investie dans des titres composant l'Indice.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

N/A – première période de référence. Pas d'élément de comparaison disponible.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- Les émissions de gaz à effet de serre des pays d'investissement
- Les pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1er janvier 2023 au 31 décembre 2023

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
SAUDI INTERNATIONAL BOND	BONS DU TRÉSOR	4,63 %	ARABIE SAOUDITE
REPUBLIC OF INDONESIA	BONS DU TRÉSOR	4,33 %	INDONÉSIE
STATE OF QATAR	BONS DU TRÉSOR	4,04 %	QATAR
FED REPUBLIC OF BRAZIL	BONS DU TRÉSOR	3,97 %	BRÉSIL
REPUBLIC OF PHILIPPINES	BONS DU TRÉSOR	3,96 %	PHILIPPINES
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	BONS DU TRÉSOR	3,76 %	URUGUAY
HUNGARY	BONS DU TRÉSOR	3,66 %	HONGRIE
REPUBLIC OF COLOMBIA	BONS DU TRÉSOR	3,59 %	COLOMBIE
DOMINICAN REPUBLIC	BONS DU TRÉSOR	3,46 %	RÉPUBLIQUE DOMINICAINE
UNITED MEXICAN STATES	BONS DU TRÉSOR	3,42 %	MEXIQUE
OMAN GOV INTERNTL BOND	BONS DU TRÉSOR	3,31 %	OMAN
ROMANIA	BONS DU TRÉSOR	3,29 %	ROUMANIE
REPUBLIC OF PANAMA	BONS DU TRÉSOR	3,12 %	PANAMA
REPUBLIC OF CHILE	BONS DU TRÉSOR	2,91 %	CHILI
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	BONS DU TRÉSOR	2,78 %	AFRIQUE DU SUD

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

96,38 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 3,62 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.

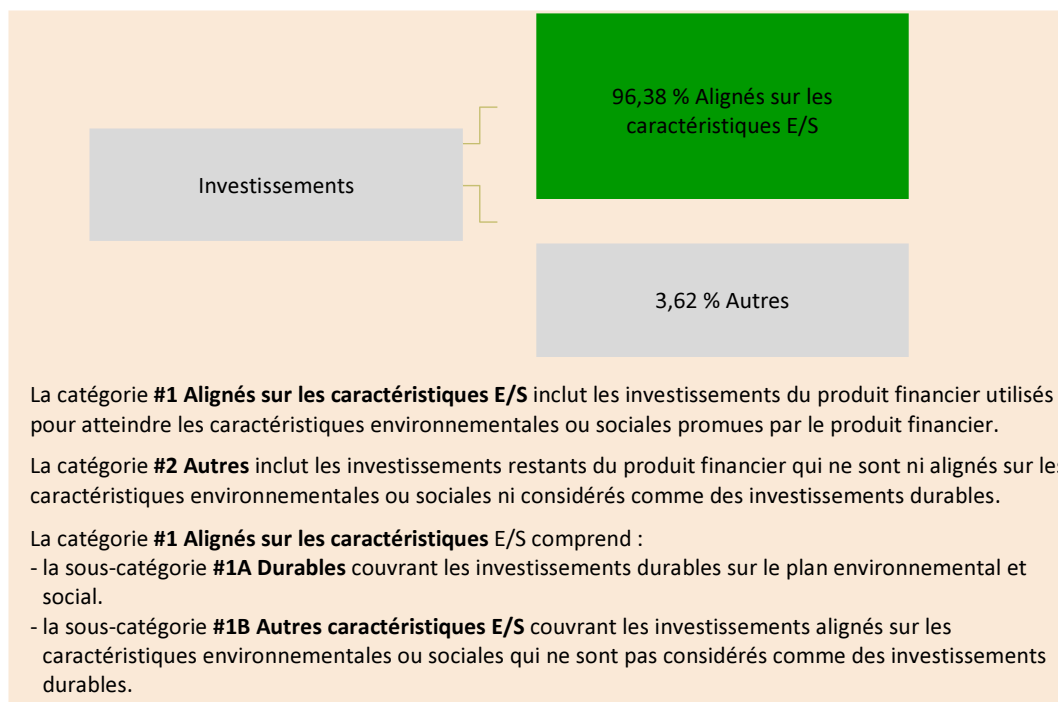
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

SOUVERAINS	90,31 %
BONS DU TRÉSOR	5,63 %
GARANTIS PAR L'ÉTAT	1,67 %
ACTIFS NON GARANTIS	2,39 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

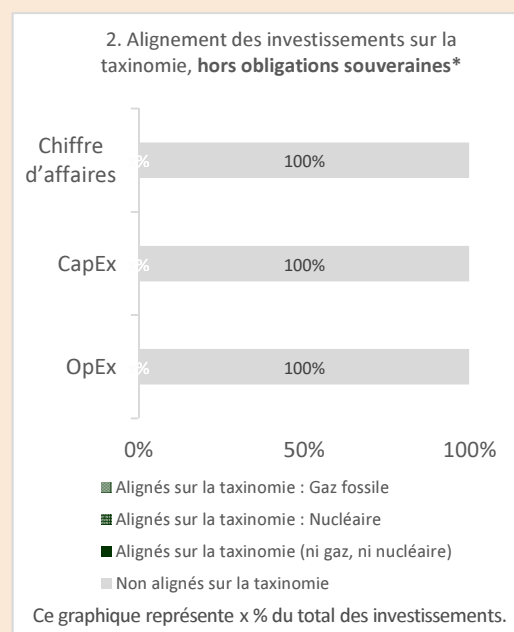
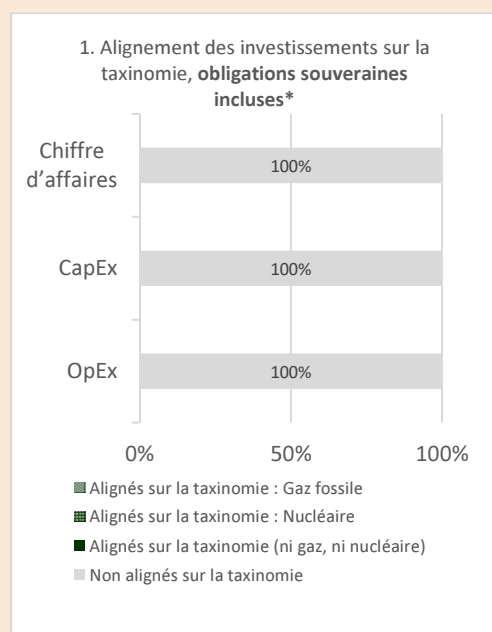
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.


● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
 - En gaz fossile
 - En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 3,62 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG qui utilise les scores émetteurs JESG afin d'orienter ses composantes sur les émetteurs les mieux classés en fonction des critères ESG et des émissions d'obligations vertes, et de sous-pondérer et retirer les émetteurs moins bien classés.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. L'Indice mesure la performance des obligations d'État des marchés émergents émises au public et libellées en dollars américains.

L'Indice applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG qui utilise les scores émetteurs JESG, ainsi que les exclusions éthiques et le filtrage négatif JESG, afin d'orienter ses composantes sur les émetteurs les mieux classés en fonction des critères ESG et des émissions d'obligations vertes, et de sous-pondérer et retirer les émetteurs moins bien classés.

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision constante ainsi qu'un rééquilibrage le dernier jour ouvrable du mois aux États-Unis.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance ne s'applique pas aux obligations d'État conformément aux « Questions relatives au Règlement (UE) 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR) » de la Commission européenne publiées le 25 mai 2022.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?



L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Le Compartiment a été amorcé le 14 décembre, l'écart de suivi avec l'indice n'est pas représentatif.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer à la méthodologie de l'indice Morgan ESG GBI-EM Global Diversified Index :

<https://www.jpmorgan.com/country/US/en/jpmorgan/investbk/solutions/research/indices/product>

● En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?

L'Indice est basé sur l'indice J.P. Morgan EMBI Global Diversified Index, son indice parent, lequel couvre la performance des obligations d'État des marchés émergents émises en souscription publique et libellées en dollars américains. L'Indice désigné du Compartiment (c.-à-d. l'indice J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index) applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG qui utilise les scores émetteurs JESG, ainsi que les exclusions éthiques et le filtrage négatif JESG sur les composantes de l'indice parent, afin d'orienter ses propres composantes sur les émetteurs les mieux classés en fonction des critères ESG et des émissions d'obligations vertes, et de sous-pondérer et retirer les émetteurs moins bien classés.

● Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?

La méthodologie de l'Indice prévoit une révision constante ainsi qu'un rééquilibrage le dernier jour ouvrable du mois aux États-Unis.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice.

L'Indice mesure la performance des obligations d'État des marchés émergents en devise locale investissable. L'Indice applique une méthodologie de notation et de filtrage ESG qui utilise les scores émetteurs JESG afin d'orienter ses composantes sur les émetteurs les mieux classés en fonction des critères ESG et des émissions d'obligations vertes, et de sous-pondérer et retirer les émetteurs moins bien classés.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

La politique d'investissement du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index aussi étroitement que possible au moyen de la Stratégie d'échantillonnage stratifié tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Le Compartiment a été amorcé le 14 décembre, l'écart de suivi avec l'indice n'est pas représentatif.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a été amorcé le 14 décembre, l'écart de suivi avec l'indice n'est pas représentatif.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Japan Screened Index Equity Fund
 Identifiant d'entité juridique : 549300VGM1FD3NHD2W32

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Oui	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de __ % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social :	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street Japan Screened Index Equity Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI Japan ex UNGC and CW Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment.

L'Indice représente la performance du marché actions japonais au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du Pacte mondial des Nations unies (le « PMNU »). Le Compartiment cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales reflétées dans les critères d'exclusion intégrés dans l'Indice comme indiqué ci-dessus, lequel inclut leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. le défaut de conformité aux principes du PMNU (normes internationales relatives à l'environnement, aux droits de l'homme et des communautés, aux droits du travail et aux chaînes d'approvisionnement, aux consommateurs et à la gouvernance) ainsi que les armes controversées.

L'écart de suivi sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,14 %. L'écart de performance tient à l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les pondérations de titres inadéquates, le revenu obtenu du prêt des titres, la capitalisation et les avantages fiscaux.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée au moyen des exclusions appliquées par le portefeuille concerné et listées dans la question précédente. Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice.

Plus précisément, l'Indice prend en considération

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
TOYOTA MOTOR CORP	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	5,04 %	JAPON
SONY GROUP CORP	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	3,22 %	JAPON
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	FINANCES	2,54 %	JAPON
KEYENCE CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,47 %	JAPON
TOKYO ELECTRON LTD	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,91 %	JAPON
SHIN ETSU CHEMICAL CO LTD	MATERIAUX	1,78 %	JAPON
HITACHI LTD	INDUSTRIES	1,68 %	JAPON
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	FINANCES	1,66 %	JAPON
DAIICHI SANKYO CO LTD	SOINS DE SANTÉ	1,61 %	JAPON
MITSUBISHI CORP	INDUSTRIES	1,53 %	JAPON
TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	SOINS DE SANTÉ	1,39 %	JAPON
MITSUMI + CO LTD	INDUSTRIES	1,36 %	JAPON
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	INDUSTRIES	1,36 %	JAPON
HONDA MOTOR CO LTD	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,36 %	JAPON
KDDI CORP	SERVICES DE COMMUNICATION	1,36 %	JAPON

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

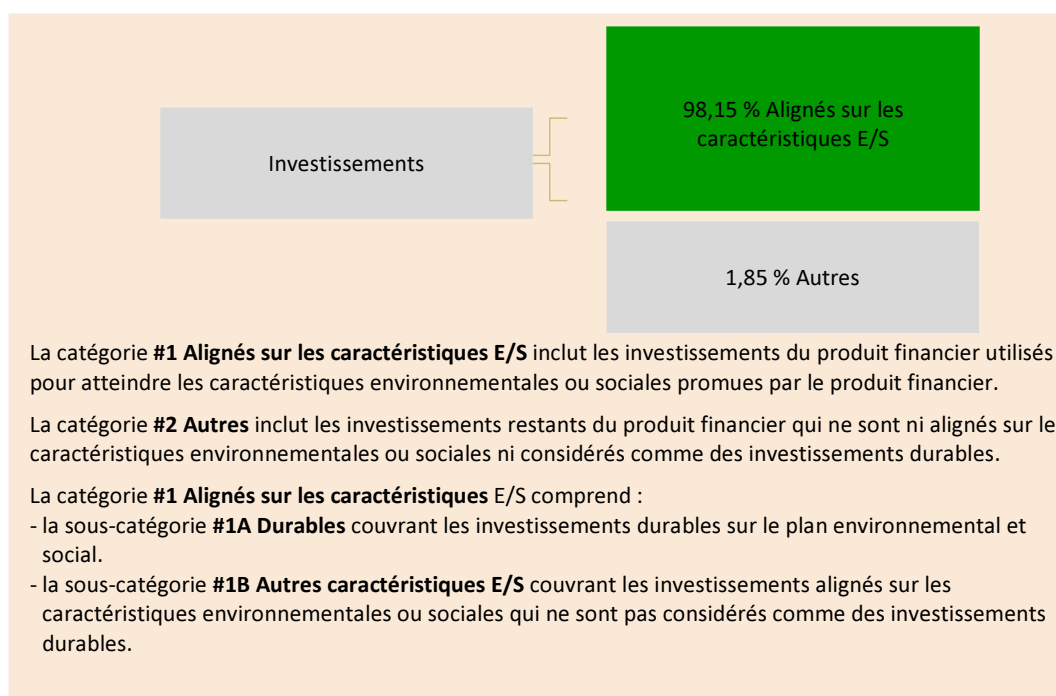


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

98,15 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,85 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

INDUSTRIES	23,73 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	5,86 %
MACHINES-OUTILS	4,94 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	2,81 %
ROUTE ET RAIL	2,28 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,94 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	1,69 %
SERVICES PROFESSIONNELS	1,58 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,74 %
SECTEUR MARITIME	0,73 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,60 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,38 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,18 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	18,97 %
AUTOMOBILES	8,00 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	4,60 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	1,93 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	1,65 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,26 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,83 %
MÉDIAS	0,32 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,22 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	0,16 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	14,10 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	5,53 %
SEMI-CONDUCTEURS	4,37 %
SERVICES INFORMATIQUES	2,29 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	1,66 %
LOGICIELS	0,26 %
FINANCES	11,77 %
BANQUES	6,65 %
ASSURANCE	3,34 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	0,96 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	0,75 %
SERVICES FINANCIERS	0,07 %
SOINS DE SANTÉ	8,76 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	5,86 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,65 %
TECHNOLOGIE DES SOINS DE SANTÉ	0,26 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	6,21 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,61 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	1,27 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	1,12 %
BOISSONS	0,99 %
TABAC	0,79 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,43 %
SERVICES DE COMMUNICATION	5,68 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	3,63 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	1,03 %
DIVERTISSEMENTS	0,72 %
MÉDIAS	0,30 %
MATÉRIAUX	4,79 %
PRODUITS CHIMIQUES	3,72 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	0,98 %

PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,09 %
IMMOBILIER	2,99 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	1,98 %
REIT DE BUREAUX	0,33 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,26 %
REIT INDUSTRIELS	0,26 %
REIT COMMERCIAUX	0,14 %
REIT DIVERSIFIÉS	0,03 %
SERVICES PUBLICS	0,90 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	0,47 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,42 %
ÉNERGIE	0,80 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	0,80 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

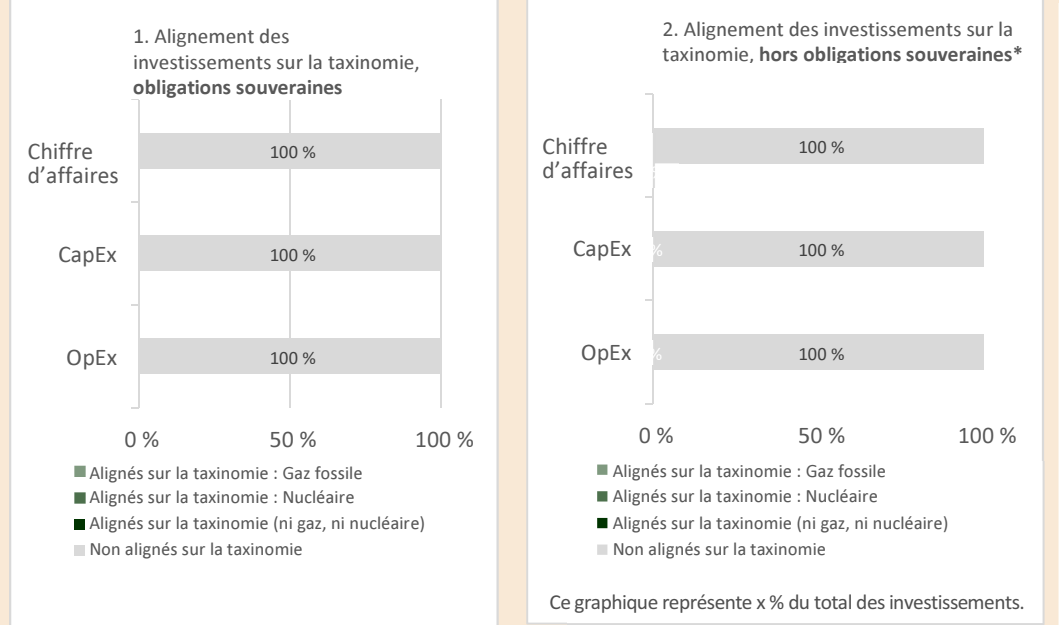
- Oui :
- En gaz fossile En énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.


● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.

● **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.

● **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,85 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indicial qui réplique la performance de l'indice MSCI Japan ex UNGC and CW Index. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre des critères d'exclusion concernant les entreprises qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus. Le Compartiment est rééquilibré tous les trimestres, conformément à la fréquence de rééquilibrage de l'Indice.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers d'un filtrage négatif appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI Japan ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2022, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 28,65 % sur une base brute de commissions et surperformé de 14 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 28,51 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 28,27 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance du Compartiment est principalement attribuable à l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les pondérations de titres inadéquates, le revenu obtenu du prêt des titres, la capitalisation et les avantages fiscaux.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indiciaire de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.msci.com/index-methodology> (code indice 731089)

● **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice est basé sur l'indice MSCI Japan Index, son indice parent, lequel couvre la représentation des grandes et moyennes capitalisations sur l'ensemble du marché actions japonais. L'Indice désigné du Compartiment (c.-à-d. l'indice MSCI Japan ex UNGC and CW Index) représente la performance des marchés actions japonais, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU. La sélection des composantes est basée sur les données de MSCI ESG Research.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI Japan ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 28,65 % sur une base brute de commissions et surperformé de 14 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 28,51 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 28,27 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance du Compartiment est principalement attribuable à l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les pondérations de titres inadéquates, le revenu obtenu du prêt des titres, la capitalisation et les avantages fiscaux.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 28,65 % sur une base brute de commissions et surperformé de 0,09 % le rendement de l'indice de marché large établi à 28,56 %.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street US Screened Index Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300GJIUYMSW1FVL54

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____%	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de __ % d'investissements durables.
<input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	<input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
<input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	<input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input type="checkbox"/> ayant un objectif social
	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street US Screened Index Equity Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI USA ex UNGC and CW Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment.

L'Indice représente la performance du marché actions américain au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU).



Les indicateurs de durabilité évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier

Le Compartiment cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales reflétées dans les facteurs d'exclusion intégrés dans l'Indice comme indiqué ci-dessus, lequel inclut leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. le défaut de conformité aux principes du PMNU (normes internationales relatives à l'environnement, aux droits de l'homme et des communautés, aux droits du travail et aux chaînes d'approvisionnement, aux consommateurs et à la gouvernance) ainsi que les armes controversées.

L'écart de suivi sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,11 %. L'écart de performance résulte de l'effet combiné de petits facteurs, tels que les liquidités non investies, la sélection des titres, la fiscalité et la capitalisation.

● ***Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?***

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée au moyen des exclusions appliquées par le portefeuille concerné et listées dans la question précédente. Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● ***...et par rapport aux périodes précédentes ?***

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● ***Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?***

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
APPLE INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	7,35 %	ÉTATS-UNIS
MICROSOFT CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	6,01 %	ÉTATS-UNIS
AMAZON.COM INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	3,04 %	ÉTATS-UNIS
NVIDIA CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,58 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,89 %	ÉTATS-UNIS
TESLA INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,75 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL C	SERVICES DE COMMUNICATION	1,71 %	ÉTATS-UNIS
META PLATFORMS INC CLASS A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,64 %	ÉTATS-UNIS
UNITEDHEALTH GROUP INC	SOINS DE SANTÉ	1,19 %	ÉTATS-UNIS
EXXON MOBIL CORP	ÉNERGIE	1,15 %	ÉTATS-UNIS

BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	FINANCES	1,14 %	ÉTATS-UNIS
JPMORGAN CHASE + CO	FINANCES	1,11 %	ÉTATS-UNIS
JOHNSON + JOHNSON	SOINS DE SANTÉ	1,04 %	ÉTATS-UNIS
ELI LILLY + CO	SOINS DE SANTÉ	1,00 %	ÉTATS-UNIS
VISA INC CLASS A SHARES	FINANCES	0,99 %	ÉTATS-UNIS

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,33 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,67 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	28,06 %
-------------------------------	---------

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

LOGICIELS	10,32 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	7,64 %
SEMI-CONDUCTEURS	7,18 %
SERVICES INFORMATIQUES	1,45 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,86 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,62 %
SOINS DE SANTÉ	13,29 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	3,90 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	2,80 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,62 %
BIOTECHNOLOGIE	2,28 %
SCIENCES DE LA VIE	1,61 %
TECHNOLOGIE DES SOINS DE SANTÉ	0,08 %
FINANCES	12,57 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	3,08 %
BANQUES	3,00 %
SERVICES FINANCIERS	2,57 %
ASSURANCE	2,14 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,25 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,51 %
REIT HYPOTHÉCAIRES	0,02 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	10,72 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	3,29 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	2,21 %
AUTOMOBILES	2,06 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	2,03 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	0,51 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,35 %
DISTRIBUTEURS	0,13 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,12 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,02 %
SERVICES DE COMMUNICATION	8,54 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	5,36 %
DIVERTISSEMENTS	1,40 %
MÉDIAS	0,85 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	0,72 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,21 %
INDUSTRIES	8,02 %
MACHINES-OUTILS	1,79 %
ROUTE ET RAIL	1,02 %
SERVICES PROFESSIONNELS	0,83 %

CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	0,80 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,74 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	0,61 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,61 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,58 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,54 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,36 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,11 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,03 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	6,47 %
BOISSONS	1,65 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,49 %
PRODUITS DOMESTIQUES	1,28 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	0,98 %
TABAC	0,58 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,33 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,11 %
PRODUITS DE SOINS PERSONNELS	0,04 %
ÉNERGIE	4,35 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	3,99 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,36 %
IMMOBILIER	2,55 %
REIT SPÉCIALISÉS	1,10 %
REIT RÉSIDENTIELS	0,41 %
REIT INDUSTRIELS	0,29 %
REIT COMMERCIAUX	0,25 %
REIT – SANTÉ	0,19 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,15 %
REIT DE BUREAUX	0,07 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,04 %
REIT – HÔTELS ET COMPLEXES HÔTELIERS	0,03 %
MATÉRIAUX	2,54 %
PRODUITS CHIMIQUES	1,69 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	0,46 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,25 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,14 %
SERVICES PUBLICS	2,46 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,57 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,68 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,09 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,06 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,05 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

● Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

En gaz fossile


En énergie nucléaire

Non

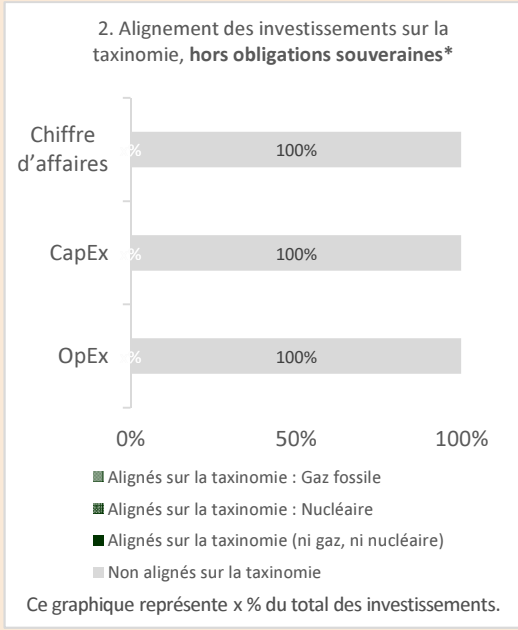
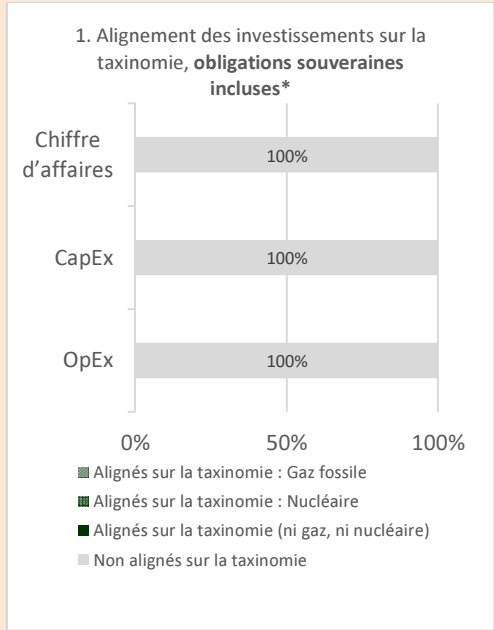
¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.**

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.

 **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.

 **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,67 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI USA ex UNGC and CW Index. L'Indice a été conçu aux fins d'atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre des critères d'exclusion concernant les entreprises qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers d'un filtrage négatif appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI USA ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 26,79 % sur une base brute de commissions et surperformé de 11 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 26,69 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 26,48 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La sous-performance du Compartiment est principalement imputable à l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les décalages entre les pondérations de titres, la capitalisation et les avantages fiscaux.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indiciaire de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.msci.com/index-methodology> (code indice 731082)

● **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice est basé sur l'indice MSCI USA Index, son indice parent, lequel couvre la représentation des grandes et moyennes capitalisations sur l'ensemble du marché actions américain. L'Indice désigné du Compartiment (c.-à-d. l'indice MSCI USA ex UNGC and CW Index) représente la performance des marchés actions développés américains au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU.

La sélection des composantes est basée sur les données de MSCI ESG Research.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI USA ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 26,79 % sur une base brute de commissions et surperformé de 11 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 20,69 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 26,48 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La sous-performance du Compartiment est principalement imputable à l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les décalages entre les pondérations de titres, la capitalisation et les avantages fiscaux.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 26,79 % sur une base brute de commissions et surperformé de 0,30 % le rendement de l'indice de marché large établi à 26,49 %.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street EMU Screened Index Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300R5J6NXXZ98RS45

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Oui	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street EMU Screened Index Equity Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI EMU ex UNGC and CW Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment. L'Indice représente la performance des marchés actions développés de l'Union économique et monétaire (UEM) au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU).

Le Compartiment cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales reflétées dans les facteurs d'exclusion intégrés dans l'Indice comme indiqué ci-dessus, lequel inclut leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. le défaut de conformité aux principes du PMNU (normes internationales relatives à l'environnement, aux droits de l'homme et des communautés, aux droits du travail et aux chaînes d'approvisionnement, aux consommateurs et à la gouvernance) ainsi que les armes controversées.

L'écart de performance sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,61 %. L'écart de performance résulte principalement de l'avantage fiscal du Compartiment par rapport à l'indice et d'une combinaison d'autres petits facteurs tels que les liquidités non investies, la sélection des titres et la capitalisation.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée au moyen des exclusions appliquées par le portefeuille concerné et listées dans la question précédente. Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?



Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
ASML HOLDING NV	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	5,33 %	PAYS-BAS
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	4,56 %	FRANCE
TOTALENERGIES SE	ÉNERGIE	2,83 %	FRANCE
SAP SE	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,75 %	ALLEMAGNE
SIEMENS AG REG	INDUSTRIES	2,41 %	ALLEMAGNE
SANOFI	SOINS DE SANTÉ	2,32 %	FRANCE
L OREAL	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	2,12 %	FRANCE
ALLIANZ SE REG	FINANCES	1,89 %	ALLEMAGNE
SCHNEIDER ELECTRIC SE	INDUSTRIES	1,87 %	FRANCE
AIR LIQUIDE SA	MATÉRIAUX	1,79 %	FRANCE
AIRBUS SE	INDUSTRIES	1,62 %	PAYS-BAS
IBERDROLA SA	SERVICES PUBLICS	1,44 %	ESPAGNE
DEUTSCHE TELEKOM AG REG	SERVICES DE COMMUNICATION	1,42 %	ALLEMAGNE
BNP PARIBAS	FINANCES	1,34 %	FRANCE
HERMES INTERNATIONAL	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,24 %	FRANCE

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,62 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,38 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la



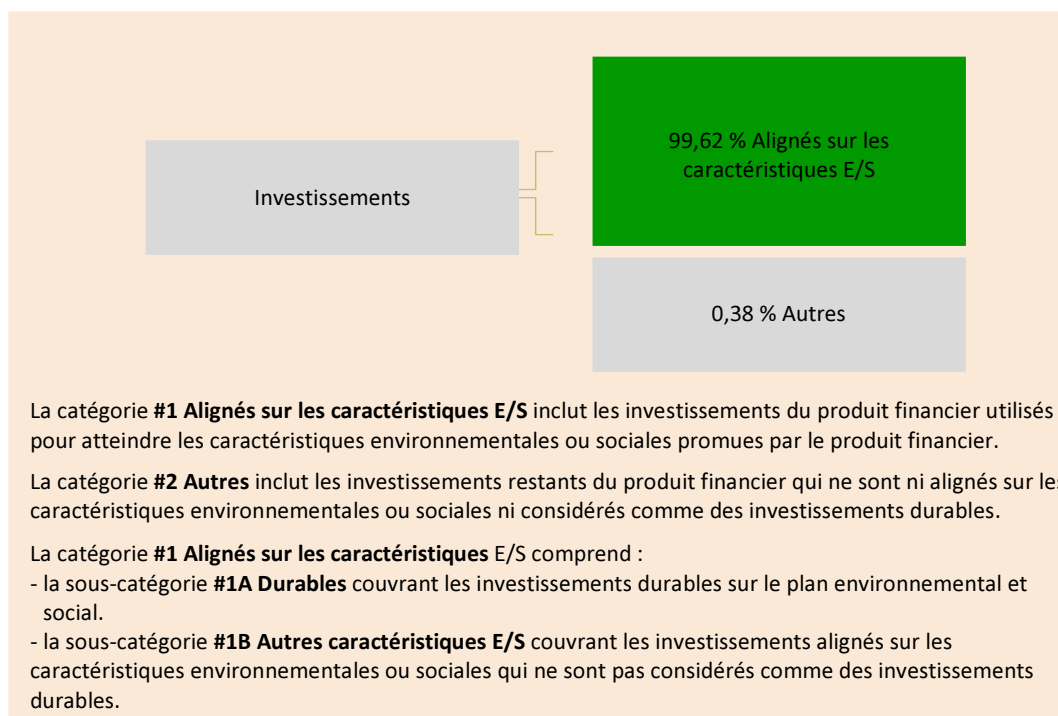
La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

FINANCES	17,43 %
BANQUES	8,77 %
ASSURANCE	5,77 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	1,31 %
SERVICES FINANCIERS	1,10 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	0,48 %
INDUSTRIES	16,14 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	3,57 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	2,74 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	2,41 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	1,94 %
MACHINES-OUTILS	1,54 %
SERVICES PROFESSIONNELS	1,11 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,89 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,79 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,61 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,43 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,11 %

BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	15,94 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	7,53 %
AUTOMOBILES	3,95 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,73 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	1,02 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	0,93 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,64 %
DISTRIBUTEURS	0,08 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,05 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	11,93 %
SEMI-CONDUCTEURS	7,47 %
LOGICIELS	3,39 %
SERVICES INFORMATIQUES	0,66 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,42 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	8,01 %
BOISSONS	2,96 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	2,38 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,14 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	1,14 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,39 %
SOINS DE SANTÉ	7,82 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	4,19 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	1,92 %
SCIENCES DE LA VIE	0,69 %
BIOTECHNOLOGIE	0,52 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	0,50 %
SERVICES PUBLICS	6,17 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	3,63 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	1,51 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,67 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,36 %
MATÉRIAUX	5,90 %
PRODUITS CHIMIQUES	4,31 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,60 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,49 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	0,33 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,18 %
ÉNERGIE	4,64 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	4,50 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,14 %
SERVICES DE COMMUNICATION	4,30 %

SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	3,21 %
MÉDIAS	0,50 %
DIVERTISSEMENTS	0,50 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	0,10 %
IMMOBILIER	0,89 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,44 %
REIT COMMERCIAUX	0,23 %
REIT DE BUREAUX	0,12 %
REIT INDUSTRIELS	0,09 %
REIT DIVERSIFIÉS	0,01 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

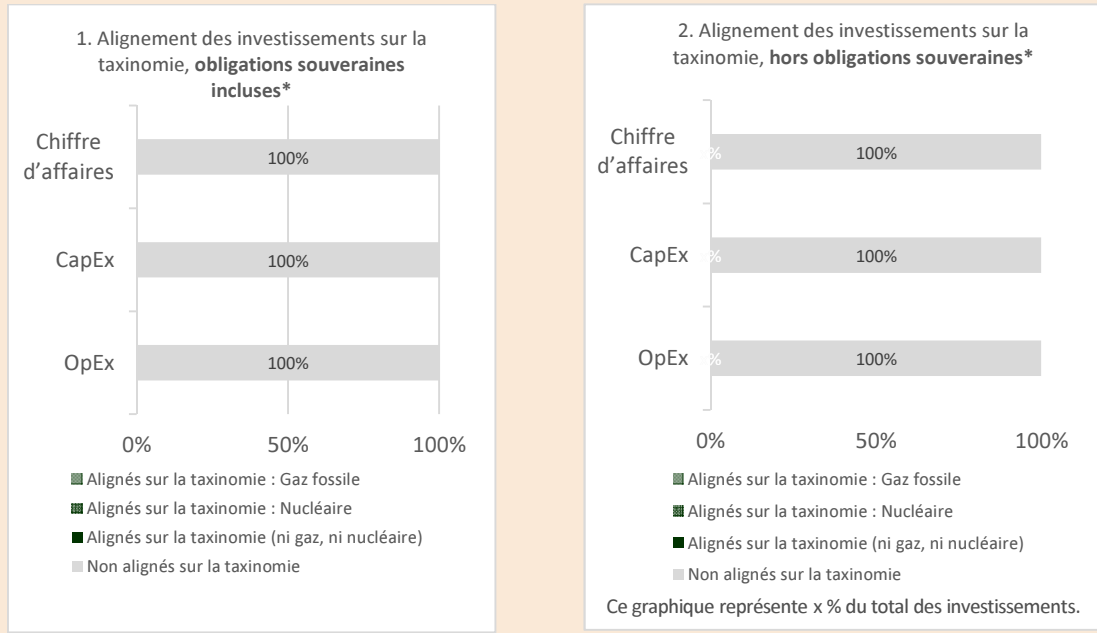
- Oui :
- En gaz fossile En énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.


● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.

● **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.

● **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,38 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indicial qui réplique la performance de l'indice MSCI EMU ex UNGC and CW Index. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre des critères d'exclusion concernant les entreprises qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus. Le Compartiment est rééquilibré tous les trimestres, conformément à la fréquence de rééquilibrage de l'Indice.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers d'un filtrage négatif appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI EMU ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 19,57 % sur une base brute de commissions et surperformé de 61 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 18,96 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 19,26 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance du Compartiment est principalement attribuable à l'avantage fiscal récurrent dont bénéficie la SICAV par rapport à l'indice MSCI.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indicielle de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.msci.com/index-methodology> (code indice 731087)

● **En quoi l'indice de référence diffèrait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice est basé sur l'indice MSCI EMU Index, son indice parent, lequel couvre la représentation des grandes et moyennes capitalisations sur l'ensemble des marchés développés de 5 l'UEM. L'Indice désigné du Compartiment (c.-à-d. l'indice MSCI EMU ex UNGC and CW Index) représente la performance des marchés actions développés de l'UEM au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU. La sélection des composantes est basée sur les données de MSCI ESG Research.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI EMU ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 19,57 % sur une base brute de commissions et surperformé de 61 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 18,96 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 19,26 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance du Compartiment est principalement attribuable à l'avantage fiscal récurrent dont bénéficie la SICAV par rapport à l'indice MSCI.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 19,57 % sur une base brute de commissions et surperformé de 0,79 % le rendement de l'indice de marché large établi à 18,78 %.

ANNEXE VI

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**.

Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit : State Street Europe Screened Index Equity Fund
Identifiant d'entité juridique : 549300WJDD0JOI35RQ08

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Non

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il **promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street Europe Screened Index Equity Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI Europe ex UNGC and CW Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment. L'Indice représente la performance des marchés actions européens développés au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU).



Le Compartiment cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales reflétées dans les facteurs d'exclusion intégrés dans l'Indice comme indiqué ci-dessus, lequel inclut leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. le défaut de conformité aux principes du PMNU (normes internationales relatives à l'environnement, aux droits de l'homme et des communautés, aux droits du travail et aux chaînes d'approvisionnement, aux consommateurs et à la gouvernance) ainsi que les armes controversées.

L'écart de performance sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,36 %. L'écart de performance résulte principalement de l'avantage fiscal du Compartiment par rapport à l'indice et d'une combinaison d'autres petits facteurs tels que les liquidités non investies, la sélection des titres et la capitalisation.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée au moyen des exclusions appliquées par le portefeuille concerné et listées dans la question précédente. Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?



Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
NESTLE SA REG	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	3,17 %	SUISSE
NOVO NORDISK A/S B	SOINS DE SANTÉ	2,88 %	DANEMARK
ASML HOLDING NV	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,74 %	PAYS-BAS
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,34 %	FRANCE
ASTRAZENECA PLC	SOINS DE SANTÉ	2,12 %	ROYAUME-UNI
SHELL PLC	ÉNERGIE	2,07 %	ROYAUME-UNI
NOVARTIS AG REG	SOINS DE SANTÉ	2,03 %	SUISSE
ROCHE HOLDING AG GENUSSCHEIN	SOINS DE SANTÉ	2,01 %	SUISSE
HSBC HOLDINGS PLC	FINANCES	1,50 %	ROYAUME-UNI
TOTALENERGIES SE	ÉNERGIE	1,45 %	FRANCE
SAP SE	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,41 %	ALLEMAGNE
UNILEVER PLC	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,26 %	ROYAUME-UNI
SIEMENS AG REG	INDUSTRIES	1,24 %	ALLEMAGNE
SANOFI	SOINS DE SANTÉ	1,19 %	FRANCE
L OREAL	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,09 %	FRANCE

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

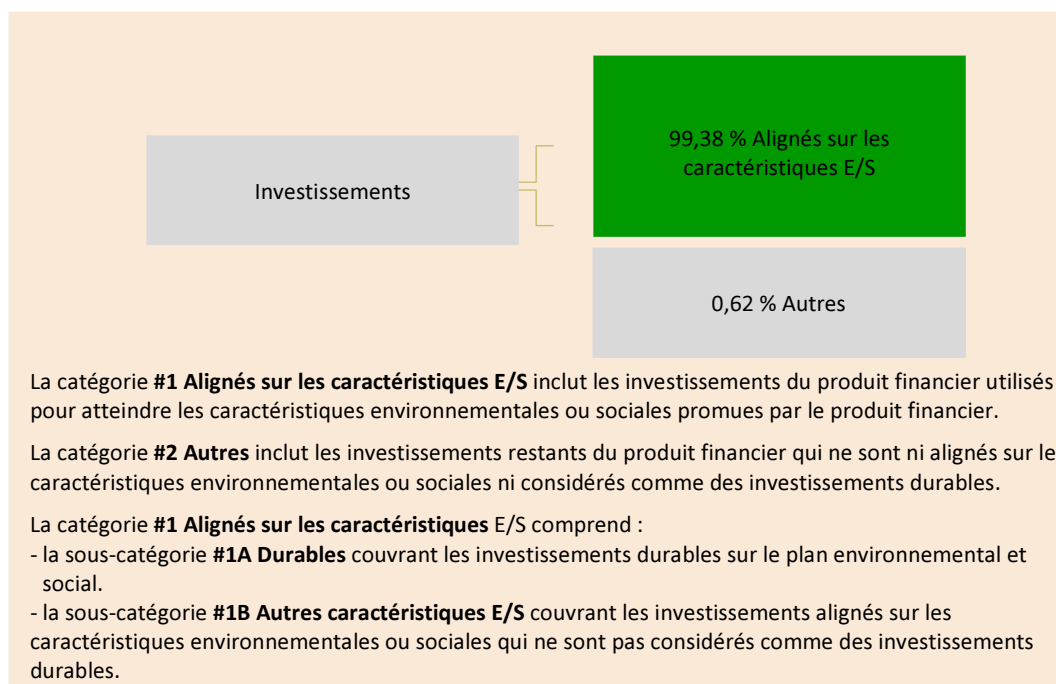
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.



- **Quelle était l'allocation des actifs ?**

99,38 % des actifs du Fonds ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,62 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

FINANCES	17,54 %
BANQUES	8,12 %
ASSURANCE	5,17 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	2,79 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	0,86 %
SERVICES FINANCIERS	0,61 %
SOINS DE SANTÉ	15,69 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	12,10 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,04 %
SCIENCES DE LA VIE	0,75 %
BIOTECHNOLOGIE	0,55 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	0,26 %
INDUSTRIES	15,30 %
MACHINES-OUTILS	2,75 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	2,53 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	2,28 %
SERVICES PROFESSIONNELS	1,85 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,48 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	1,04 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	1,00 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,81 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,76 %
SECTEUR MARITIME	0,31 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,22 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,22 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,06 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	12,30 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	4,32 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	2,70 %
BOISSONS	2,61 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	0,93 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,88 %
TABAC	0,87 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	10,86 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	4,95 %
AUTOMOBILES	2,04 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,86 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	0,70 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	0,52 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,33 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,23 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,11 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,07 %
DISTRIBUTEURS	0,04 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	6,90 %
SEMI-CONDUCTEURS	3,83 %
LOGICIELS	1,91 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,38 %
SERVICES INFORMATIQUES	0,35 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,32 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	0,12 %
MATÉRIAUX	6,47 %
PRODUITS CHIMIQUES	3,39 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	1,57 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,89 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,45 %

EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,17 %
ÉNERGIE	5,88 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	5,81 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,07 %
SERVICES PUBLICS	4,29 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	2,27 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	1,33 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,34 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,17 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,17 %
SERVICES DE COMMUNICATION	3,22 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	2,04 %
MÉDIAS	0,49 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,28 %
DIVERTISSEMENTS	0,26 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	0,15 %
IMMOBILIER	0,79 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,38 %
REIT INDUSTRIELS	0,16 %
REIT COMMERCIAUX	0,11 %
REIT DE BUREAUX	0,06 %
REIT DIVERSIFIÉS	0,04 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,02 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

- **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

Oui :

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

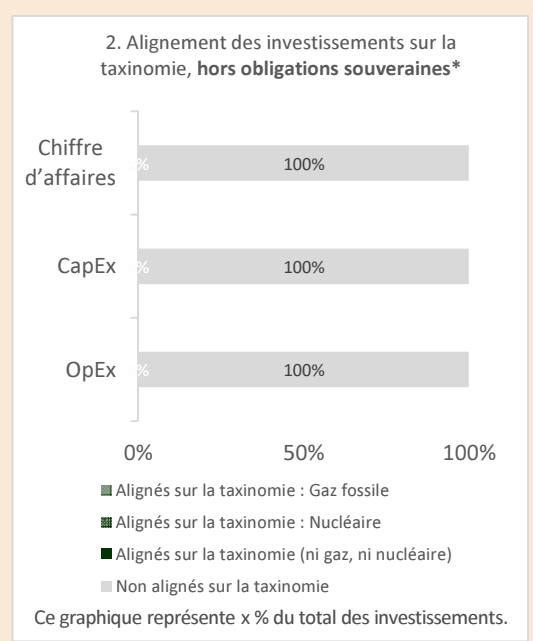
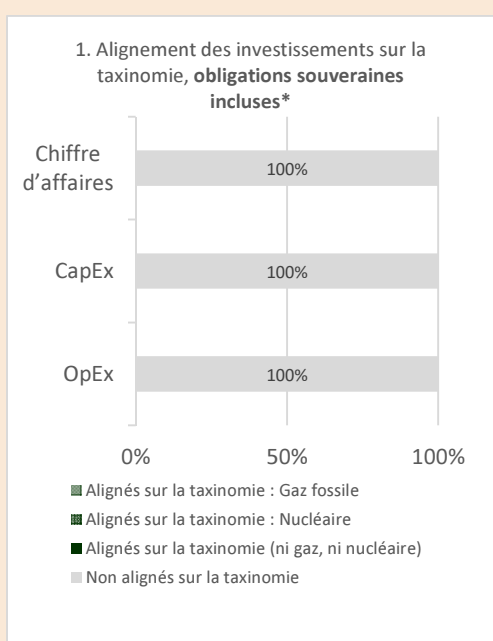
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

■ En gaz fossile ■ En énergie nucléaire

X Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.

● **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent,

représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,62 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indicial qui réplique la performance de l'indice MSCI Europe ex UNGC and CW Index. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre des critères d'exclusion concernant les entreprises qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Le Compartiment est rééquilibré tous les trimestres, conformément à la fréquence de rééquilibrage de l'Indice.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers d'un filtrage négatif appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI Europe ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 16,41 % sur une base brute de commissions et surperformé de 36 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 16,05 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 16,12 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance du Compartiment résulte principalement de son avantage fiscal par rapport à l'indice et d'une combinaison d'autres petits facteurs tels que les liquidités non investies, la sélection des titres et la capitalisation.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indicielle de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.msci.com/index-methodology> (code indice 731085)

● **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice est basé sur l'indice MSCI Europe Index, son indice parent, lequel couvre la représentation des grandes et moyennes capitalisations sur l'ensemble des marchés développés en Europe. L'Indice désigné du Compartiment (c.-à-d. l'indice MSCI Europe ex UNGC and CW Index) représente la performance des marchés actions européens développés au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU. La sélection des composantes est basée sur les données de MSCI ESG Research.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice.

Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI Europe ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2022, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 16,41 % sur une base brute de commissions et surperformé de 36 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 16,05 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 16,12 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance du Compartiment résulte principalement de son avantage fiscal par rapport à l'indice et d'une combinaison d'autres petits facteurs tels que les liquidités non investies, la sélection des titres et la capitalisation.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 16,41 % sur une base brute de commissions et surperformé de 0,58 % le rendement de l'indice de marché large établi à 15,83 %.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300ADYHHVDGUHHI73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street Pacific Ex-Japan Screened Index Equity Fund est un fonds indicel qui réplique la performance de l'indice MSCI Pacific ex Japan ex UNGC and CW Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment. L'Indice représente la performance des marchés actions développés du Pacifique au sens large (hors Japon), tout en excluant les sociétés qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU).

Le Compartiment cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales reflétées dans les facteurs d'exclusion intégrés dans l'Indice comme indiqué ci-dessus, lequel inclut leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. le défaut de conformité aux principes du PMNU (normes internationales relatives à l'environnement, aux droits de l'homme et des communautés, aux droits du travail et aux chaînes d'approvisionnement, aux consommateurs et à la gouvernance) ainsi que les armes controversées.

L'écart de suivi sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,17 %. Le Compartiment a légèrement surperformé l'Indice de référence MSCI en raison d'avantages fiscaux et de petits facteurs tels que les liquidités non investies et la sélection de titres.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée au moyen des exclusions appliquées par le portefeuille concerné et listées dans la question précédente. Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	FINANCES	7,03 %	AUSTRALIE
AIA GROUP LTD	FINANCES	6,65 %	HONG KONG
CSL LTD	SOINS DE SANTÉ	5,42 %	AUSTRALIE
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	FINANCES	3,64 %	AUSTRALIE
WESTPAC BANKING CORP	FINANCES	3,11 %	AUSTRALIE
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	FINANCES	3,00 %	AUSTRALIE
HONG KONG EXCHANGES + CLEAR	FINANCES	2,83 %	HONG KONG
DBS GROUP HOLDINGS LTD	FINANCES	2,70 %	SINGAPOUR
MACQUARIE GROUP LTD	FINANCES	2,63 %	AUSTRALIE
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	ÉNERGIE	2,62 %	AUSTRALIE
WESFARMERS LTD	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,42 %	AUSTRALIE
FORTESCUE LTD	MATÉRIAUX	1,99 %	AUSTRALIE
OVERSEA CHINESE BANKING CORP	FINANCES	1,94 %	SINGAPOUR
WOOLWORTHS GROUP LTD	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,88 %	AUSTRALIE
RIO TINTO LTD	MATÉRIAUX	1,83 %	AUSTRALIE

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



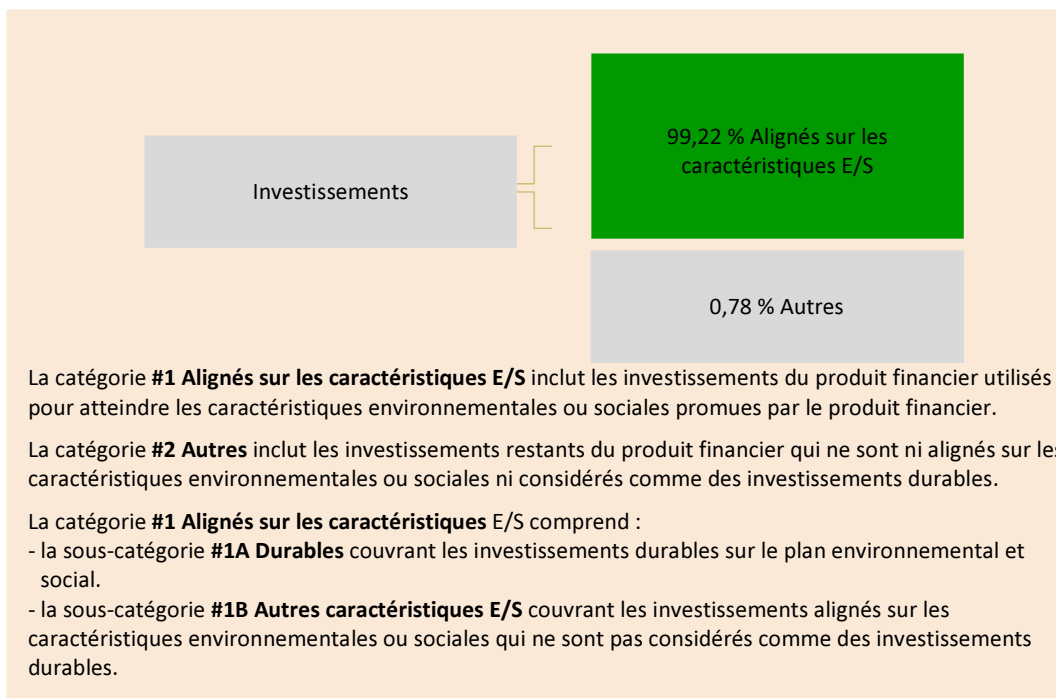
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,22 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et

sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,78 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

FINANCES	40,20 %
BANQUES	24,29 %
ASSURANCE	9,18 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	6,49 %
SERVICES FINANCIERS	0,23 %
IMMOBILIER	10,79 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	4,81 %
REIT COMMERCIAUX	2,38 %
REIT INDUSTRIELS	2,20 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	1,07 %
REIT DE BUREAUX	0,33 %
INDUSTRIES	8,94 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	2,12 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,97 %
MACHINES-OUTILS	1,09 %
ROUTE ET RAIL	1,04 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,79 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

COMPAGNIES AÉRIENNES	0,64 %
SERVICES PROFESSIONNELS	0,55 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,27 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,17 %
SECTEUR MARITIME	0,16 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,15 %
MATÉRIAUX	8,18 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	7,14 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,76 %
PRODUITS CHIMIQUES	0,29 %
SOINS DE SANTÉ	7,89 %
BIOTECHNOLOGIE	5,42 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	1,25 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	1,22 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	5,60 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	2,96 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	2,42 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,22 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	4,39 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	3,15 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	0,63 %
BOISSONS	0,61 %
SERVICES DE COMMUNICATION	4,18 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	2,21 %
DIVERTISSEMENTS	1,26 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	0,71 %
ÉNERGIE	3,99 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	3,99 %
SERVICES PUBLICS	3,57 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	2,17 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	1,02 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,27 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,10 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,26 %
LOGICIELS	1,09 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,10 %
LOGICIELS ET SERVICES INTERNET	0,08 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

● Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

En gaz fossile


En énergie nucléaire

Non

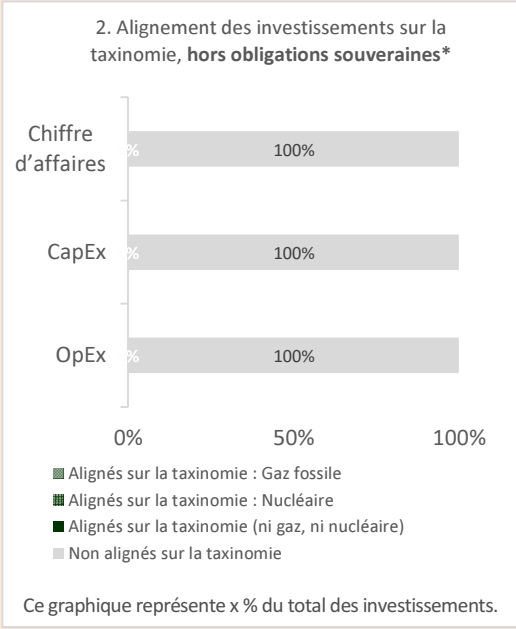
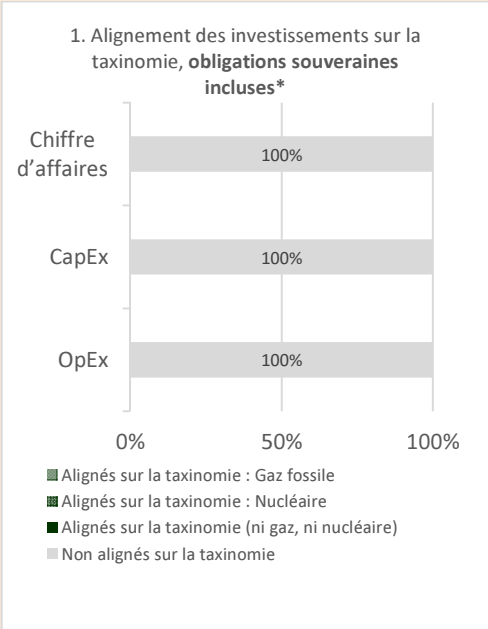
¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables** sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.

 **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.

 **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,78 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI Pacific ex Japan ex UNGC and CW Index. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre des critères d'exclusion concernant les entreprises qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus. Le Compartiment est rééquilibré tous les trimestres, conformément à la fréquence de rééquilibrage de l'Indice.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers d'un filtrage négatif appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI Pacific ex Japan ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2022, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 5,53 % sur une base brute de commissions et surperformé de 17 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 5,36 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 5,23 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance du Compartiment est due aux avantages fiscaux et à de petits facteurs tels que les liquidités non investies ou la sélection des titres.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indicielle de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.msci.com/index-methodology> (code indice 731091)

● **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice est basé sur l'indice MSCI Pacific ex Japan Index, son indice parent, lequel couvre la représentation des grandes et moyennes capitalisations sur l'ensemble du marché actions de la région Pacifique hors Japon. L'Indice désigné du Compartiment (c.-à-d. l'indice MSCI Pacific ex Japan ex UNGC and CW Index) représente la performance des marchés actions développés du Pacifique au sens large (hors Japon), tout en excluant les sociétés qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU. La sélection des composantes est basée sur les données de MSCI ESG Research.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI Pacific ex Japan ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 5,53 % sur une base brute de commissions et surperformé de 17 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 5,36 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 5,23 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. La surperformance du Compartiment est due aux avantages fiscaux et à de petits facteurs tels que les liquidités non investies ou la sélection des titres.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 5,53 % sur une base brute de commissions et sous-performé de 0,91 % le rendement de l'indice de marché large établi à 6,44 %.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street World Screened Index Equity Fund
Identifiant d'entité juridique : 549300EBNZR6OL5DHO74

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____%



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%



Non



Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de __ % d'investissements durables.



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street World Screened Index Equity Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI World ex UNGC and CW Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment. L'Indice représente la performance des marchés actions européens développés au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU).

Le Compartiment cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales reflétées dans les facteurs d'exclusion intégrés dans l'Indice comme indiqué ci-dessus, lequel inclut leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. le défaut de conformité aux principes du PMNU (normes internationales relatives à l'environnement, aux droits de l'homme et des communautés, aux droits du travail et aux chaînes d'approvisionnement, aux consommateurs et à la gouvernance) ainsi que les armes controversées.

L'écart de performance sur un an au 31 décembre 2023 s'établissait à 0,15 %. L'écart de performance résulte principalement des avantages fiscaux, mais aussi de l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les pondérations de titres inadéquates et la capitalisation.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée au moyen des exclusions appliquées par le portefeuille concerné et listées dans la question précédente. Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
APPLE INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	5,10 %	ÉTATS-UNIS
MICROSOFT CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	4,16 %	ÉTATS-UNIS
AMAZON.COM INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,11 %	ÉTATS-UNIS
NVIDIA CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,79 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,31 %	ÉTATS-UNIS
TESLA INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,22 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL C	SERVICES DE COMMUNICATION	1,18 %	ÉTATS-UNIS
META PLATFORMS INC CLASS A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,14 %	ÉTATS-UNIS
UNITEDHEALTH GROUP INC	SOINS DE SANTÉ	0,83 %	ÉTATS-UNIS
EXXON MOBIL CORP	ÉNERGIE	0,79 %	ÉTATS-UNIS
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	FINANCES	0,79 %	ÉTATS-UNIS
JPMORGAN CHASE + CO	FINANCES	0,77 %	ÉTATS-UNIS
JOHNSON + JOHNSON	SOINS DE SANTÉ	0,72 %	ÉTATS-UNIS
ELI LILLY + CO	SOINS DE SANTÉ	0,69 %	ÉTATS-UNIS
JOHNSON + JOHNSON W/D	SOINS DE SANTÉ	0,69 %	ÉTATS-UNIS

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

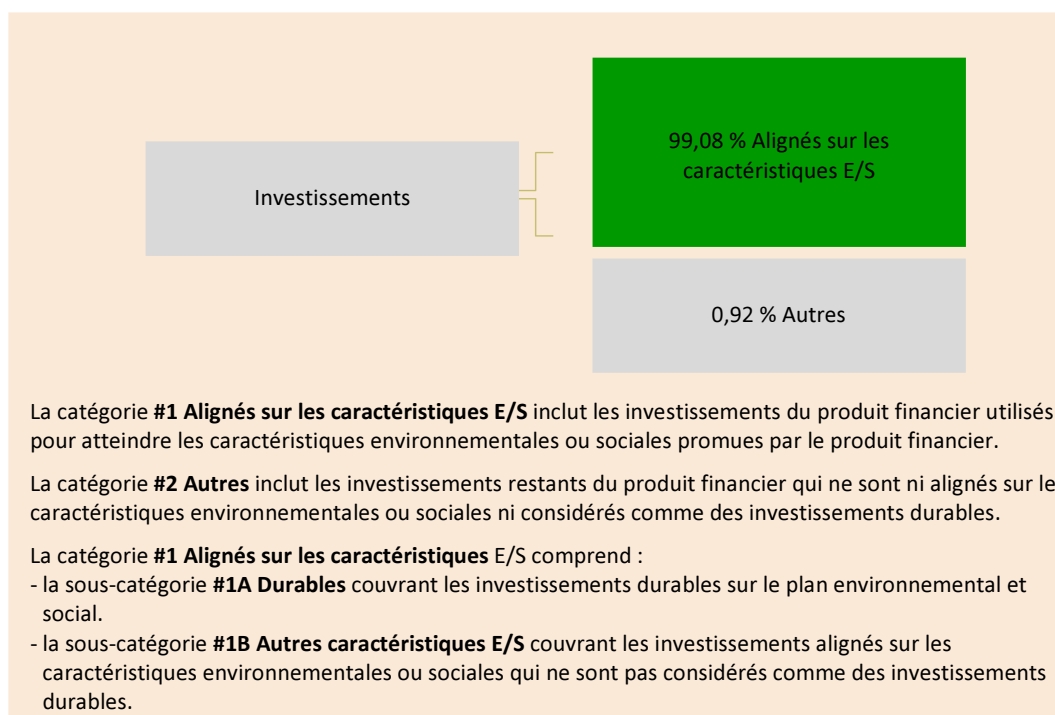


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,08 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,92 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	21,96 %
LOGICIELS	7,73 %
SEMI-CONDUCTEURS	5,93 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	5,43 %
SERVICES INFORMATIQUES	1,38 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,84 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,66 %
LOGICIELS ET SERVICES INTERNET	0,00 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

FINANCES	15,01 %
BANQUES	5,52 %
ASSURANCE	3,11 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	3,05 %
SERVICES FINANCIERS	1,90 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,07 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,34 %
REIT HYPOTHÉCAIRES	0,02 %
SOINS DE SANTÉ	12,84 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	5,27 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,37 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	2,04 %
BIOTECHNOLOGIE	1,85 %
SCIENCES DE LA VIE	1,24 %
TECHNOLOGIE DES SOINS DE SANTÉ	0,07 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	10,87 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	2,39 %
AUTOMOBILES	2,29 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	2,06 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	1,64 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	1,28 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,57 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,29 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,16 %
DISTRIBUTEURS	0,10 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,07 %
MÉDIAS	0,02 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,01 %
INDUSTRIES	10,50 %
MACHINES-OUTILS	2,06 %
SERVICES PROFESSIONNELS	1,08 %
ROUTE ET RAIL	1,06 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	1,01 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	1,01 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,01 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,76 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,69 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,56 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,56 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,34 %
SECTEUR MARITIME	0,10 %
TRANSPORT TERRESTRE	0,10 %

INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,09 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,07 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	7,38 %
BOISSONS	1,68 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	1,58 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,54 %
PRODUITS DOMESTIQUES	1,08 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,63 %
TABAC	0,60 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,23 %
PRODUITS DE SOINS PERSONNELS	0,03 %
SERVICES DE COMMUNICATION	7,04 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	3,78 %
DIVERTISSEMENTS	1,11 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	1,03 %
MÉDIAS	0,68 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,45 %
ÉNERGIE	4,83 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	4,56 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,27 %
MATÉRIAUX	3,77 %
PRODUITS CHIMIQUES	2,09 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	1,08 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,29 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,22 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,10 %
SERVICES PUBLICS	2,75 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,65 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,74 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,14 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,13 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,10 %
IMMOBILIER	2,44 %
REIT SPÉCIALISÉS	0,77 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,45 %
REIT INDUSTRIELS	0,31 %
REIT RÉSIDENTIELS	0,29 %
REIT COMMERCIAUX	0,28 %
REIT – SANTÉ	0,13 %
REIT DE BUREAUX	0,10 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,08 %
REIT – HÔTELS ET COMPLEXES HÔTELIERS	0,02 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

● Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

En gaz fossile


En énergie nucléaire

Non

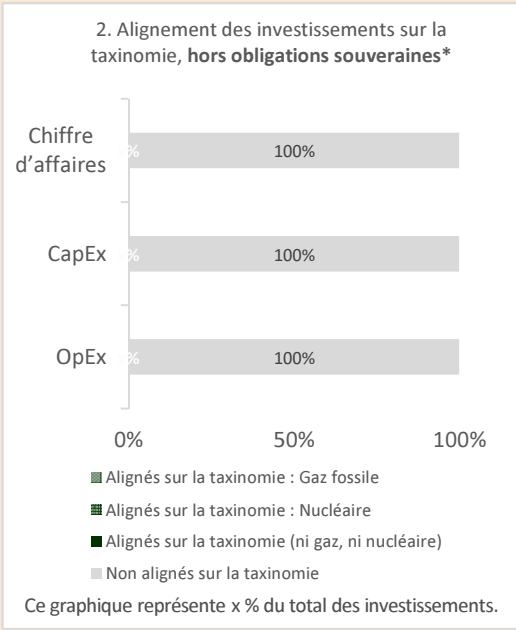
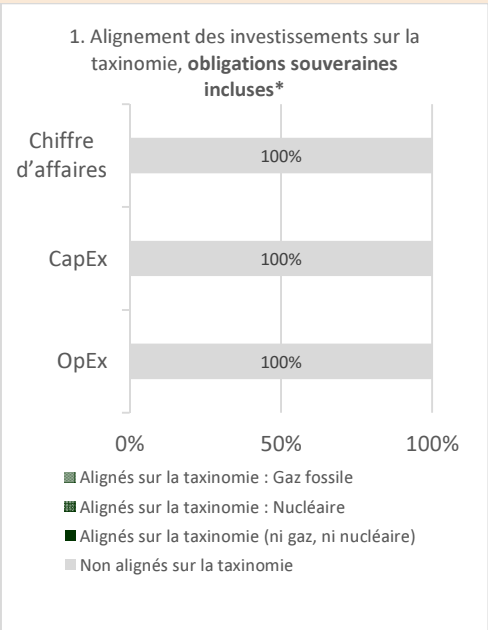
¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.**

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



● **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,92 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI World ex UNGC and CW Index. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre des critères d'exclusion concernant les entreprises qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus. Le Compartiment est rééquilibré tous les trimestres, conformément à la fréquence de rééquilibrage de l'Indice.



L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers d'un filtrage négatif appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI World ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 24,12 % sur une base brute de commissions et surperformé de 15 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 23,98 %. L'écart de performance résulte principalement des avantages fiscaux, mais aussi de l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les pondérations de titres inadéquates et la capitalisation. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 23,83 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indicielle de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.msci.com/index-methodology> (code indice 731077)

● **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice est basé sur l'indice MSCI World Index, son indice parent, lequel couvre la représentation des grandes et moyennes capitalisations sur l'ensemble des marchés actions développés dans le monde. L'Indice désigné du Compartiment (c.-à-d. l'indice MSCI World ex UNGC and CW Index) représente la performance des marchés actions développés dans le monde au sens large, tout en excluant les sociétés qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU. La sélection des composantes est basée sur les données de MSCI ESG Research.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI World ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2022, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 24,12 % sur une base brute de commissions et surperformé de 15 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 23,98 %. L'écart de performance résulte principalement des avantages fiscaux, mais aussi de l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les pondérations de titres inadéquates et la capitalisation. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 23,83 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 24,12 % sur une base brute de commissions et surperformé de 0,33 % le rendement de l'indice de marché large établi à 23,79 %.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street World ESG Index Equity Fund
 Identifiant d'entité juridique : 5493006KP30YBI4QYQ78

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de __ % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street World ESG Index Equity Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI World ESG Universal Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment sont celles incluses dans les notations ESG de MSCI qui sont utilisées dans la construction de l'Indice.

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

En outre, l'Indice exclut les titres en fonction des scores de controverse ESG de MSCI ainsi qu'en fonction de la recherche MSCI sur leur implication dans certaines activités commerciales (MSCI ESG Business Involvement Screening Research) comme indiqué dans la méthodologie de l'Indice.

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales reflétées dans les notations ESG et les exclusions produites par le fournisseur de l'Indice et intégrées dans la méthodologie de construction indicielle.

L'écart de suivi sur un an au 31 décembre 2022 s'établissait à 0,01 %. L'écart de performance tient à l'effet combiné de petits facteurs, dont les liquidités non investies, les pondérations de titres inadéquates, la capitalisation et les avantages fiscaux.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée via la part du portefeuille du Compartiment investie dans des titres composant l'Indice.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
MICROSOFT CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	5,00 %	ÉTATS-UNIS
APPLE INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	3,10 %	ÉTATS-UNIS
NVIDIA CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,50 %	ÉTATS-UNIS
AMAZON.COM INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,55 %	ÉTATS-UNIS
UNITEDHEALTH GROUP INC	SOINS DE SANTÉ	1,15 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL A	SERVICES DE COMMUNICATION	0,91 %	ÉTATS-UNIS
TESLA INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	0,85 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL C	SERVICES DE COMMUNICATION	0,84 %	ÉTATS-UNIS
ELI LILLY + CO	SOINS DE SANTÉ	0,79 %	ÉTATS-UNIS
HOME DEPOT INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	0,79 %	ÉTATS-UNIS
MASTERCARD INC A	FINANCES	0,74 %	ÉTATS-UNIS
NOVO NORDISK A/S B	SOINS DE SANTÉ	0,73 %	DANEMARK
ASML HOLDING NV	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,69 %	PAYS-BAS
NESTLE SA REG	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,69 %	SUISSE
JOHNSON + JOHNSON W/D	SOINS DE SANTÉ	0,62 %	ÉTATS-UNIS

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

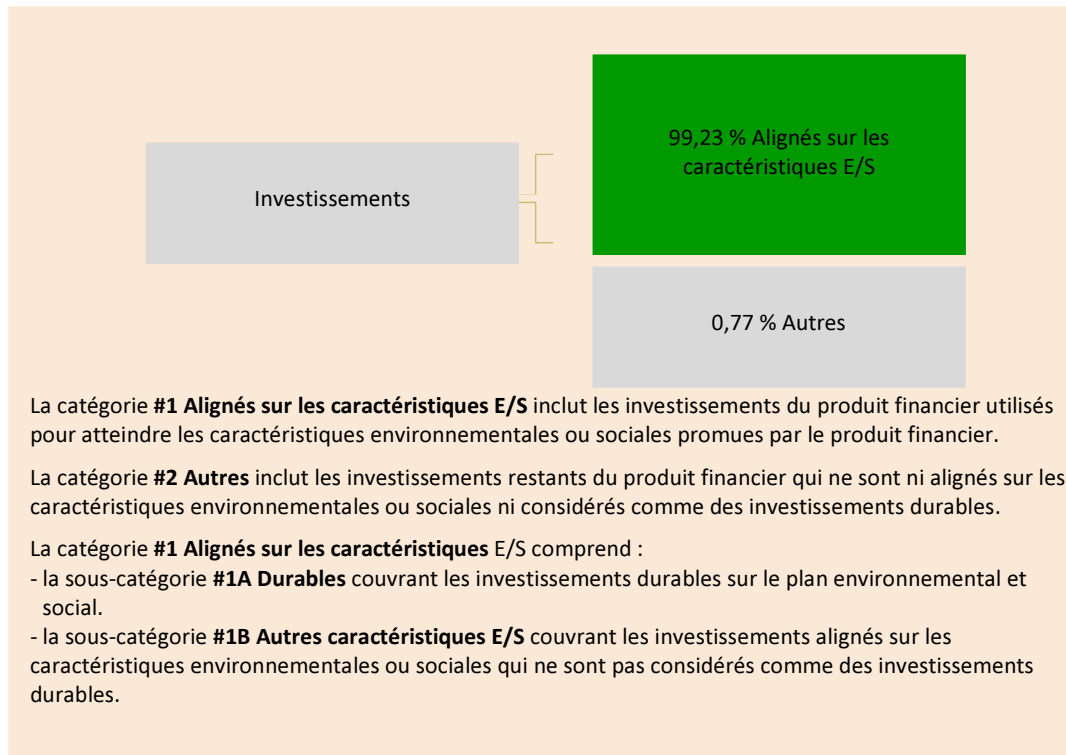
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,23 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous.

0,77 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	22,88 %
LOGICIELS	9,25 %
SEMI-CONDUCTEURS	7,08 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	3,47 %
SERVICES INFORMATIQUES	1,61 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,78 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,68 %
LOGICIELS ET SERVICES INTERNET	0,00 %

FINANCES	15,01 %
BANQUES	5,80 %
ASSURANCE	3,18 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	3,05 %
SERVICES FINANCIERS	1,74 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	0,81 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,41 %
REIT HYPOTHÉCAIRES	0,01 %
SOINS DE SANTÉ	13,54 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	5,80 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	2,45 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,20 %
BIOTECHNOLOGIE	1,73 %
SCIENCES DE LA VIE	1,32 %
TECHNOLOGIE DES SOINS DE SANTÉ	0,04 %
INDUSTRIES	10,92 %
MACHINES-OUTILS	2,19 %
SERVICES PROFESSIONNELS	1,21 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	1,14 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,07 %
ROUTE ET RAIL	0,94 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,89 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,84 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,78 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,57 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,53 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,34 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,15 %
SECTEUR MARITIME	0,12 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,09 %
TRANSPORT TERRESTRE	0,07 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	9,96 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	1,92 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	1,81 %
AUTOMOBILES	1,76 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,74 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	1,48 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,61 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,28 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,15 %
DISTRIBUTEURS	0,11 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,05 %

SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,02 %
MÉDIAS	0,02 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	7,85 %
BOISSONS	2,19 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	1,84 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,30 %
PRODUITS DOMESTIQUES	1,02 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,76 %
TABAC	0,47 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,25 %
PRODUITS DE SOINS PERSONNELS	0,01 %
SERVICES DE COMMUNICATION	5,21 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	2,27 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	1,08 %
DIVERTISSEMENTS	0,81 %
MÉDIAS	0,60 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,46 %
ÉNERGIE	4,62 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	4,30 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,32 %
MATÉRIAUX	3,75 %
PRODUITS CHIMIQUES	1,94 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	1,13 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,31 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,24 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,13 %
SERVICES PUBLICS	3,04 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,79 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,88 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,14 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,13 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,11 %
IMMOBILIER	2,43 %
REIT SPÉCIALISÉS	0,90 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,41 %
REIT INDUSTRIELS	0,32 %
REIT RÉSIDENTIELS	0,22 %
REIT COMMERCIAUX	0,22 %
REIT – SANTÉ	0,15 %
REIT DE BUREAUX	0,09 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,08 %
REIT – HÔTELS ET COMPLEXES HÔTELIERS	0,02 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

Oui :

En gaz fossile

En énergie nucléaire

Non

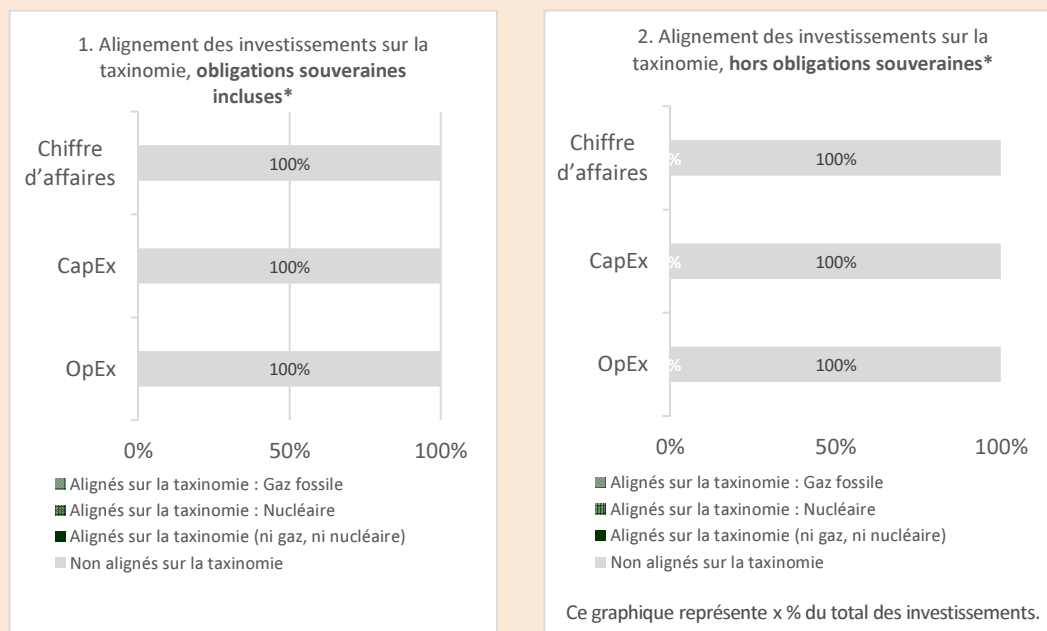
¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.**

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.

 **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.

 **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,77 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI World ESG Universal Index. L'Indice a été conçu aux fins de reproduire les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre des critères d'exclusion concernant les entreprises qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice.

Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. L'Indice mesure la performance des titres des marchés actions développés dans le monde, repondérés par rapport à la capitalisation boursière ajustée du flottant au moyen de certaines mesures ESG, en particulier des outils MSCI ESG Ratings, MSCI ESG Controversies et MSCI ESG Business Involvement Screening Research, pour s'orienter vers des titres qui affichent à la fois un profil ESG solide ainsi qu'une tendance favorable à l'amélioration de ce profil ESG.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus. Le Compartiment est rééquilibré tous les trimestres, conformément à la fréquence de rééquilibrage de l'Indice.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers d'un filtrage négatif appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?



L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI World ESG Universal Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 24,08 % sur une base brute de commissions et surperformé de 18 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 23,89 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 23,75 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indicielle de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.msci.com/index-methodology> (code indice 712650)

● **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice est basé sur l'indice MSCI World Index, son indice parent, lequel couvre la performance des titres des marchés actions développés dans le monde. L'Indice désigné du Compartiment (c.-à-d. le MSCI World ESG Universal Index) applique les notations ESG de MSCI, les scores de controverse ESG de MSCI ainsi que l'outil MSCI de recherche d'implication dans certaines activités commerciales (MSCI ESG Business Involvement Screening Research) aux composantes de l'indice parent, pour s'orienter vers des titres qui affichent un profil ESG solide ainsi qu'une tendance favorable à l'amélioration de ce profil ESG.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. L'Indice mesure la performance des titres des marchés actions développés dans le monde, repondérés par rapport à la capitalisation boursière ajustée du flottant au moyen de certaines mesures ESG, en particulier des outils MSCI ESG Ratings, MSCI ESG Controversies et MSCI ESG Business Involvement Screening Research, pour s'orienter vers des titres qui affichent à la fois un profil ESG solide ainsi qu'une tendance favorable à l'amélioration de ce profil ESG.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI World ESG Universal Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 24,08 % sur une base brute de commissions et surperformé de 18 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 23,89 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 23,75 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 24,08 % sur une base brute de commissions et surperformé de 0,29 % le rendement de l'indice de marché large établi à 23,79 %.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund
 Identifiant d'entité juridique : 549300SZ163CFCUHTR64

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment State Street Global Emerging Markets Screened Index Equity Fund est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI Emerging Markets ex UNGC and CW Index (l'« Indice »). Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à celles de l'Indice désigné par le Compartiment. L'Indice représente la performance des marchés actions émergents dans le monde au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU).

Le Compartiment cherche à promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales reflétées dans les facteurs d'exclusion intégrés dans l'Indice comme indiqué ci-dessus, lequel inclut leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. le défaut de conformité aux principes du PMNU (normes internationales relatives à l'environnement, aux droits de l'homme et des communautés, aux droits du travail et aux chaînes d'approvisionnement, aux consommateurs et à la gouvernance) ainsi que les armes controversées.

L'écart de suivi sur un an au 31 décembre 2022 s'établissait à 0,14 %. L'écart de performance résulte de l'effet combiné d'autres petits facteurs, tels que les décalages entre les pondérations de titres, la fiscalité et les frais de transaction.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée au moyen des exclusions appliquées par le portefeuille concerné et listées dans la question précédente. Le Compartiment ne détenait pas de titres qui ne répondaient pas aux critères ESG concernés.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment tient compte des Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans l'application des exclusions de l'Indice. Plus précisément, l'Indice prend en considération

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?



Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	6,63 %	TAÏWAN
TENCENT HOLDINGS LTD	SERVICES DE COMMUNICATION	4,09 %	HONG KONG
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	3,88 %	RÉPUBLIQUE DE CORÉE
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,64 %	HONG KONG
RELIANCE INDUSTRIES LTD	ÉNERGIE	1,35 %	INDE
MEITUAN CLASS B	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,13 %	HONG KONG
CHINA CONSTRUCTION BANK H	FINANCES	0,88 %	CHINE
ICICI BANK LTD	FINANCES	0,87 %	INDE
INFOSYS LTD	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,87 %	INDE
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	FINANCES	0,85 %	INDE
PDD HOLDINGS INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	0,82 %	ÉTATS-UNIS
HDFC BANK LIMITED	FINANCES	0,81 %	INDE
JD.COM INC CL A	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	0,73 %	HONG KONG
SK HYNIX INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,72 %	RÉPUBLIQUE DE CORÉE
HON HAI PRECISION INDUSTRY	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,61 %	TAÏWAN

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

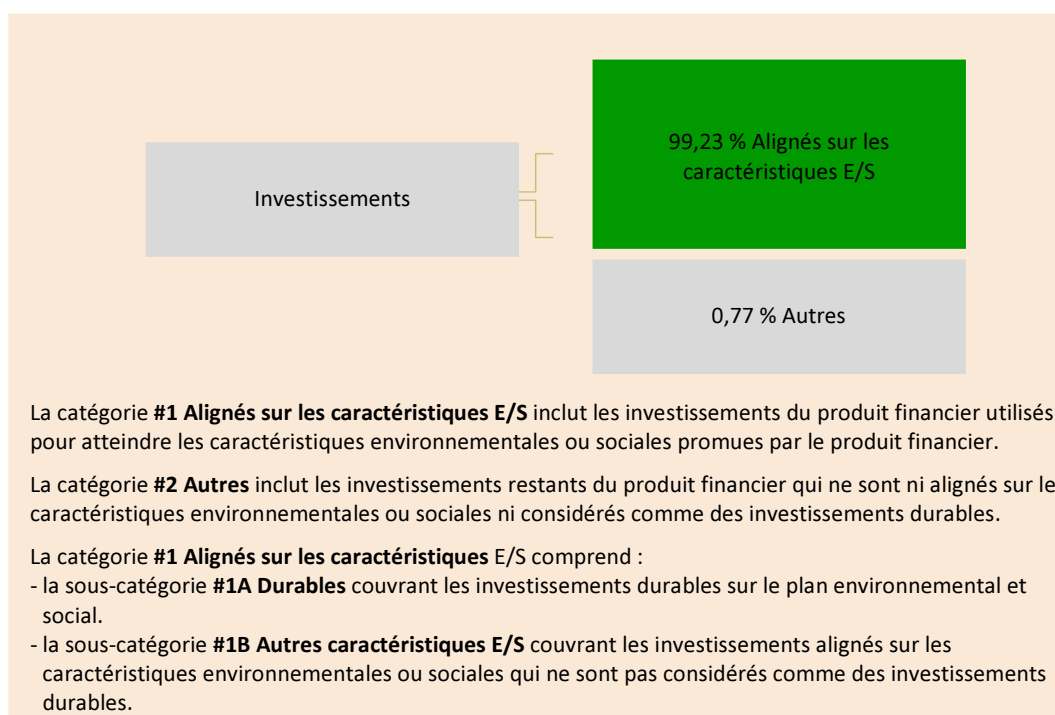


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,23 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,77 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

FINANCES	22,11 %
BANQUES	16,23 %
ASSURANCE	2,73 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,32 %
MARCHÉS DE CAPITALAUX	1,08 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,66 %
SERVICES FINANCIERS	0,09 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	20,67 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental. Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

SEMI-CONDUCTEURS	9,60 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	6,06 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	2,36 %
SERVICES INFORMATIQUES	2,12 %
LOGICIELS	0,28 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,24 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	13,50 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	4,80 %
AUTOMOBILES	3,05 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	2,44 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	1,01 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	0,77 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,60 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,36 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,20 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,20 %
MÉDIAS	0,03 %
PIÈCES AUTOMOBILES	0,02 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,02 %
DISTRIBUTEURS	0,00 %
SERVICES DE COMMUNICATION	9,75 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	5,57 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	1,63 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	1,38 %
DIVERTISSEMENTS	1,07 %
MÉDIAS	0,11 %
MATÉRIAUX	7,22 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	3,02 %
PRODUITS CHIMIQUES	2,96 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,98 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,18 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,07 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	6,30 %
BOISSONS	1,80 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	1,70 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,41 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,75 %
TABAC	0,38 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,17 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,09 %
INDUSTRIES	6,18 %

ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	1,39 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,31 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,72 %
MACHINES-OUTILS	0,63 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,35 %
SECTEUR MARITIME	0,34 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,34 %
ROUTE ET RAIL	0,33 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,31 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,24 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,13 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,06 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,04 %
ÉNERGIE	4,88 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	4,83 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,05 %
SOINS DE SANTÉ	3,79 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	1,29 %
FOURNISSEURS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	0,88 %
BIOTECHNOLOGIE	0,76 %
SCIENCES DE LA VIE	0,67 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	0,20 %
SERVICES PUBLICS	2,65 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,12 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,97 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,41 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,12 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,04 %
IMMOBILIER	1,75 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	1,65 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,10 %
REIT INDUSTRIELS	0,01 %



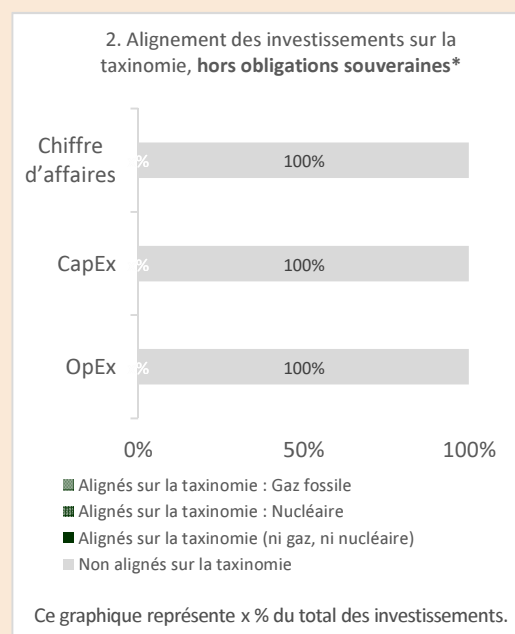
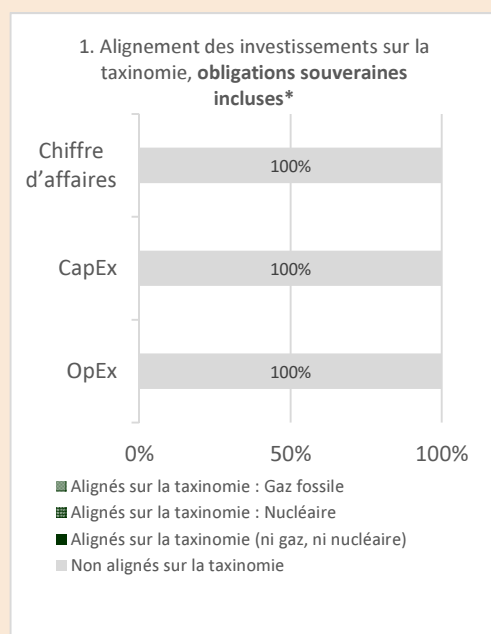
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
 - En gaz fossile
 - En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.


● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,77 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le Compartiment est un fonds indiciel qui réplique la performance de l'indice MSCI Emerging Markets ex UNGC and CW Index (l'« Indice »). L'Indice a été conçu aux fins d'atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment. L'Indice intègre des critères d'exclusion concernant les entreprises qui sont associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice.

Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus. Le Compartiment est rééquilibré tous les trimestres, conformément à la fréquence de rééquilibrage de l'Indice.

L'évaluation des pratiques de bonne gouvernance s'effectue au travers d'un filtrage négatif appliqué par l'Indice. Les sociétés que le fournisseur de l'Indice estime ne pas violer les Principes du PMNU sont considérées comme faisant preuve de bonne gouvernance.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?



L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI Emerging Markets ex UNGC and CW Index (« Indice ») aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 9,94 % sur une base brute de commissions et surperformé de 14 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 9,80 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 9,51 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. L'écart de performance résulte de l'effet combiné d'autres petits facteurs, tels que les décalages entre les pondérations de titres, la fiscalité et les frais de transaction.

Pour toutes informations sur les méthodologies utilisées dans la construction de l'Indice et davantage de renseignements sur les critères d'exclusion et les sources de données, veuillez vous référer au descriptif concernant la méthodologie indiciaire de MSCI qui peut être consulté sur le lien suivant :

<https://www.msci.com/index-methodology> (code indice 731080)

● **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

L'Indice est basé sur l'indice MSCI Emerging Markets Index, son indice parent, lequel couvre la représentation des grandes et moyennes capitalisations sur l'ensemble des marchés actions émergents dans le monde. L'Indice désigné du Compartiment (c.-à-d. l'indice MSCI Emerging Markets ex UNGC and CW Index) représente la performance des marchés actions émergents dans le monde au sens large, tout en excluant les sociétés associées aux Armes controversées ou qui ne respectent pas les principes du PMNU. La sélection des composantes est basée sur les données de MSCI ESG Research.

● **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

L'Indice est révisé et rééquilibré sur une base trimestrielle, avec mise en œuvre des changements à la clôture du dernier jour ouvrable des mois de février, mai, août et novembre au moment desquels l'Indice est examiné en fonction des critères d'exclusion ESG décrits ci-dessus.

Les titres du Compartiment sont principalement sélectionnés à partir de composantes de l'Indice. Pour résumer, le portefeuille du Compartiment reproduit sensiblement l'Indice. Le Compartiment peut également, dans des circonstances exceptionnelles, investir dans des titres qui ne sont pas inclus dans l'Indice, mais dont on estime qu'ils reflètent étroitement les caractéristiques de risque et de distribution des titres de l'Indice. Le Compartiment peut également détenir (i) des titres qui, de l'avis du Gestionnaire financier sont susceptibles d'être intégrés à l'Indice et (ii) des titres acquis dans le cadre des opérations sur titres d'une entreprise et qui peuvent ne pas être intégrés dans l'Indice. Les titres dans l'Indice sont pondérés par capitalisation boursière ajustée du flottant après exclusion des titres en fonction d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir le non-respect des principes du PMNU ainsi que les armes controversées.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

L'objectif du Compartiment consiste à répliquer la performance de l'indice MSCI Emerging Markets ex UNGC and CW Index aussi étroitement que possible tout en tâchant de minimiser autant que possible l'écart de performance avec l'Indice.

Sur l'exercice clôturé le 31 décembre 2022, le Compartiment a enregistré une performance conforme à nos attentes. Le Compartiment a généré un rendement de 9,94 % sur une base brute de commissions et surperformé de 14 points de base (pb) le rendement de l'indice de référence établi à 9,80 %. La catégorie d'actions I du Compartiment a généré une performance de 9,51 % sur une base nette de commissions au cours de la Période considérée. L'écart de performance résulte de l'effet combiné d'autres petits facteurs, tels que les décalages entre les pondérations de titres, la fiscalité et les frais de transaction.

● ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Le Compartiment a généré un rendement de 9,94 % sur une base brute de commissions et surperformé de 0,11 % le rendement de l'indice de marché large établi à 9,83 %.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 54930045LRIINCB32V69

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___%</p> <p style="margin-left: 20px;"><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p style="margin-left: 20px;"><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%</p>	<p><input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables</p> <p style="margin-left: 20px;"><input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p style="margin-left: 20px;"><input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p style="margin-left: 20px;"><input type="checkbox"/> ayant un objectif social</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables</p>

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Compartiment State Street Multi-Factor Global ESG Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à générer un rendement supérieur à la performance de l'indice MSCI World Index (l'« Indice ») sur le moyen ou long terme. Le Gestionnaire financier intègre le Risque de durabilité, tout en excluant des titres sur la base de l'évaluation de leur observation des normes internationales dans des domaines comme la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail et anticorruption ainsi que les armes controversées.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**.

Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent à l'utilisation des notations ESG et autres mesures de données ESG pour orienter la composition du portefeuille vers des titres assortis d'expositions favorables aux critères ESG concernés. En outre, d'autres caractéristiques environnementales ou sociales sont promues au moyen d'un filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille du Compartiment pour éliminer les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées. Le Compartiment peut utiliser des filtres ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure les titres sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs de ces critères ESG.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée par le score des notations ESG du portefeuille.

La réalisation effective des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- les émissions de gaz à effet de serre
- l’empreinte carbone
- l’intensité des gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements
- l’exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- la part de consommation et de production d’énergie non renouvelable
- l’intensité de consommation d’énergie par secteur à fort impact climatique
- les activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité
- les rejets dans l’eau
- le ratio de déchets dangereux et de déchets radioactifs
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l’écart de rémunération entre hommes et femmes non corrigé
- la mixité au sein des organes de gouvernance
- l’exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d’actifs	Pays
MICROSOFT CORP	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	3,55 %	ÉTATS-UNIS
APPLE INC	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	2,93 %	ÉTATS-UNIS
ACCENTURE PLC CL A	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	2,70 %	IRLANDE
META PLATFORMS INC CLASS A	SERVICES DE COMMUNICATION	2,48 %	ÉTATS-UNIS
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	FINANCES	2,47 %	ÉTATS-UNIS
CISCO SYSTEMS INC	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	2,47 %	ÉTATS-UNIS
NVIDIA CORP	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	2,14 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL C	SERVICES DE COMMUNICATION	2,07 %	ÉTATS-UNIS
NOVO NORDISK A/S B	SOINS DE SANTÉ	1,99 %	DANEMARK
ROYAL BANK OF CANADA	FINANCES	1,98 %	CANADA
L OREAL	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,95 %	FRANCE
TEXAS INSTRUMENTS INC	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	1,90 %	ÉTATS-UNIS

AUTOMATIC DATA PROCESSING	INDUSTRIES	1,73 %	ÉTATS-UNIS
SCHNEIDER ELECTRIC SE	INDUSTRIES	1,71 %	FRANCE
EATON CORP PLC	INDUSTRIES	1,46 %	IRLANDE

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

98,84 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,16 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.

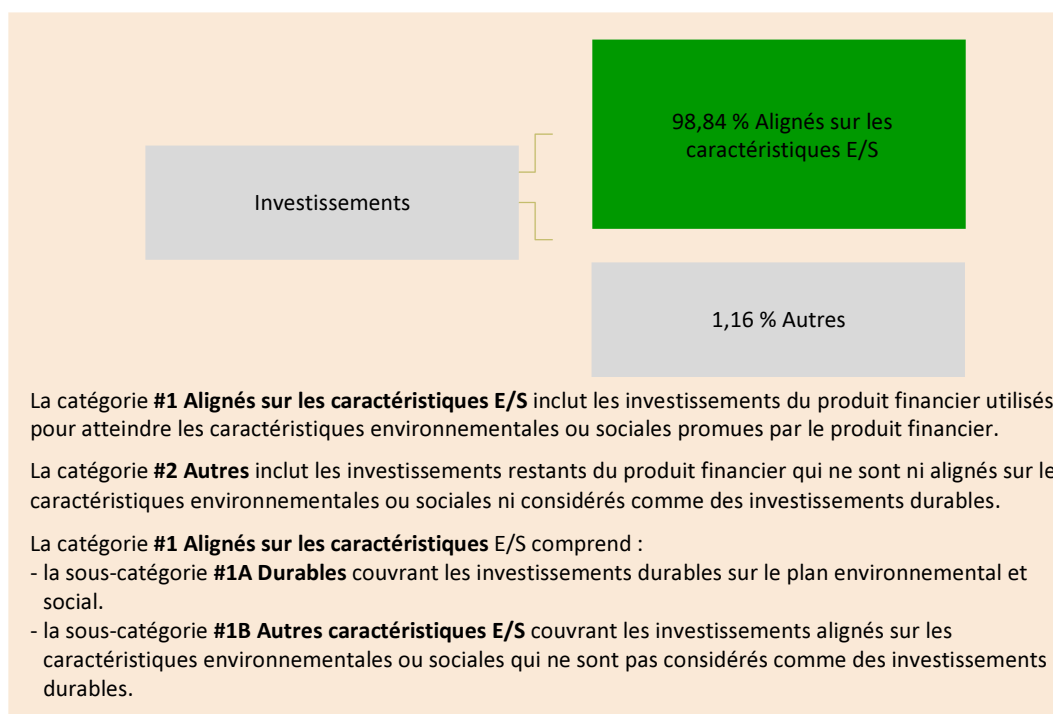


Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035.

Pour l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	23,96 %
LOGICIELS	7,67 %
SEMI-CONDUCTEURS	4,96 %

ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	4,57 %
SERVICES INFORMATIQUES	3,89 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	2,64 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,23 %
FINANCES	16,31 %
ASSURANCE	6,55 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	3,95 %
BANQUES	3,43 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	2,10 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,16 %
SERVICES FINANCIERS	0,11 %
INDUSTRIES	14,03 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	3,50 %
MACHINES-OUTILS	2,94 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	2,01 %
SERVICES PROFESSIONNELS	1,90 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	1,32 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,96 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,52 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	0,24 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,20 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,18 %
ROUTE ET RAIL	0,14 %
TRANSPORT TERRESTRE	0,11 %
SECTEUR MARITIME	0,02 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	9,30 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	4,13 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	2,20 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,10 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,94 %
BOISSONS	0,54 %
TABAC	0,37 %
PRODUITS DE SOINS PERSONNELS	0,01 %
SOINS DE SANTÉ	8,36 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	4,70 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	1,19 %
BIOTECHNOLOGIE	0,96 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	0,96 %
SCIENCES DE LA VIE	0,56 %
MATÉRIAUX	6,78 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	2,89 %
PRODUITS CHIMIQUES	1,97 %

MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	1,03 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,48 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,41 %
SERVICES DE COMMUNICATION	6,35 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	2,82 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	2,75 %
MÉDIAS	0,41 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,27 %
DIVERTISSEMENTS	0,10 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	6,13 %
AUTOMOBILES	2,97 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	1,16 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,97 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	0,79 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	0,18 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	0,07 %
ÉNERGIE	2,89 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	2,89 %
IMMOBILIER	2,81 %
REIT SPÉCIALISÉS	0,66 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,53 %
REIT RÉSIDENTIELS	0,45 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,32 %
REIT DE BUREAUX	0,29 %
REIT COMMERCIAUX	0,23 %
REIT – HÔTELS ET COMPLEXES HÔTELIERS	0,22 %
REIT INDUSTRIELS	0,11 %
SERVICES PUBLICS	2,34 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	2,22 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,12 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

● Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

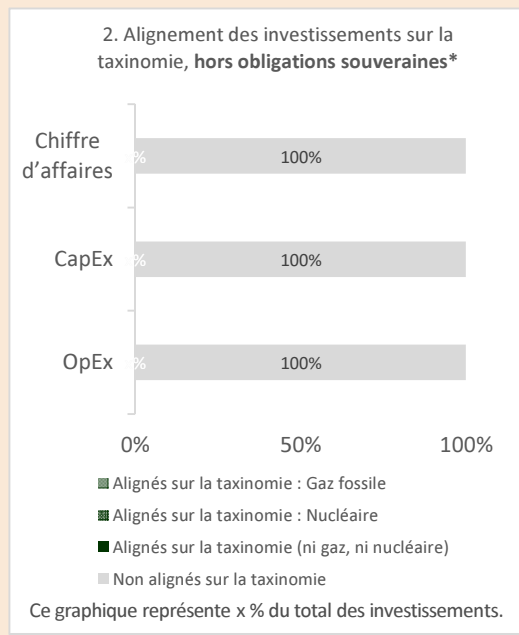
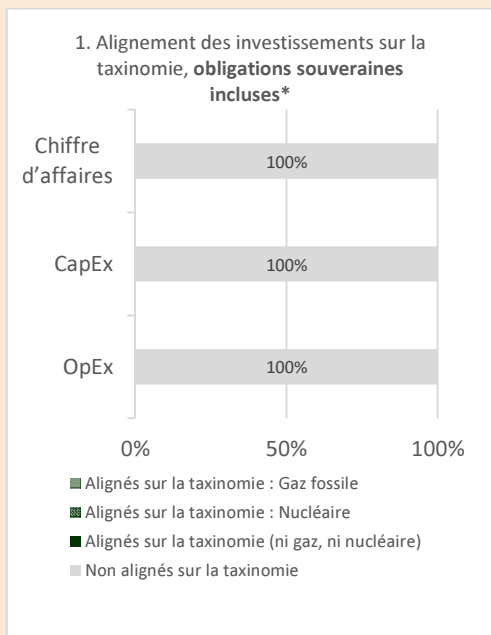
¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Oui :
 En gaz fossile En énergie nucléaire
 Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,16 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Pour instaurer cette stratégie, le Gestionnaire financier orientera la composition du portefeuille sur des titres assortis d'expositions favorables aux facteurs concernés qui sont pris en compte dans le processus d'investissement, dont les notations ESG des titres individuels. Les titres du Compartiment sont sélectionnés principalement parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 54930076IJU42ZJN9M77

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Oui	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Compartiment State Street Europe ESG Screened Enhanced Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à surperformer l'indice MSCI Europe Index (l'« Indice ») sur le moyen et long terme tout en excluant des titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte anti-corruption et les armes controversées.

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille tout au long de la période pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?



La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

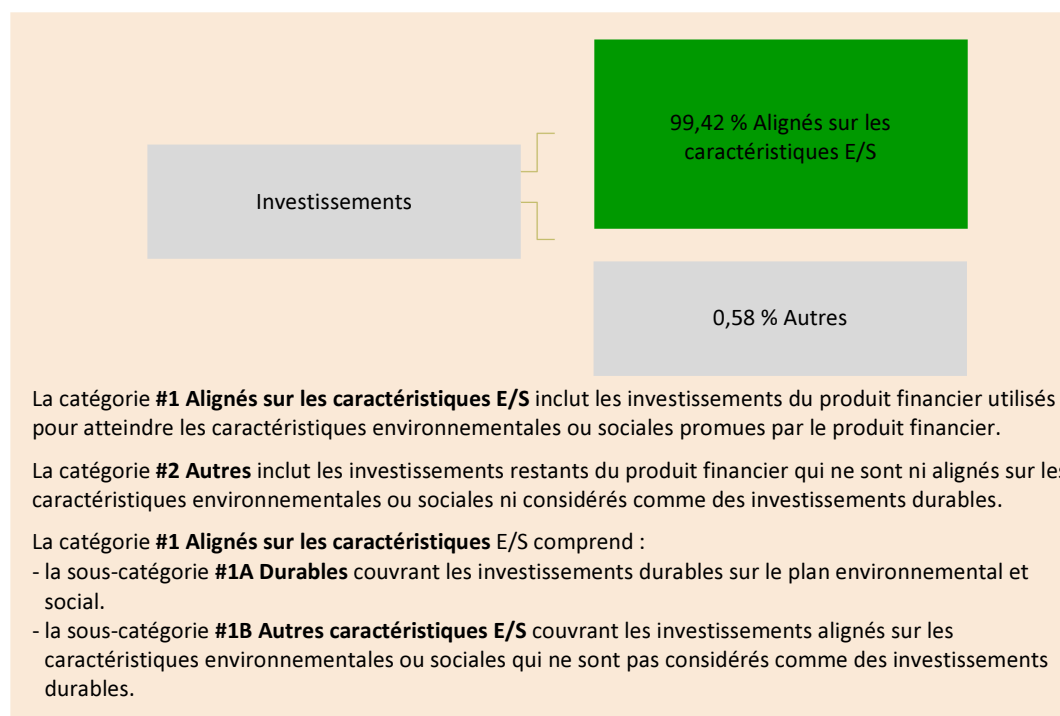
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
NOVO NORDISK A/S B	SOINS DE SANTÉ	3,10 %	DANEMARK
NESTLE SA REG	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	2,92 %	SUISSE
ASML HOLDING NV	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,51 %	PAYS-BAS
SHELL PLC	ÉNERGIE	2,35 %	ROYAUME-UNI
NOVARTIS AG REG	SOINS DE SANTÉ	2,31 %	SUISSE
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,25 %	FRANCE
ASTRAZENECA PLC	SOINS DE SANTÉ	1,89 %	ROYAUME-UNI
ROCHE HOLDING AG GENUSSCHEIN	SOINS DE SANTÉ	1,80 %	SUISSE
TOTALENERGIES SE	ÉNERGIE	1,63 %	FRANCE
SAP SE	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,47 %	ALLEMAGNE
SANOFI	SOINS DE SANTÉ	1,47 %	FRANCE
HSBC HOLDINGS PLC	FINANCES	1,41 %	ROYAUME-UNI
L OREAL	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,38 %	FRANCE
SIEMENS AG REG	INDUSTRIES	1,29 %	ALLEMAGNE
BP PLC	ÉNERGIE	1,25 %	ROYAUME-UNI

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,42 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,58 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

FINANCES	17,40 %
BANQUES	8,18 %
ASSURANCE	5,07 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	2,71 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,21 %
SERVICES FINANCIERS	0,24 %
SOINS DE SANTÉ	15,66 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	12,09 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,09 %

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

BIOTECHNOLOGIE	0,59 %
SCIENCES DE LA VIE	0,53 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	0,37 %
INDUSTRIES	15,19 %
MACHINES-OUTILS	2,61 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	2,21 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	2,18 %
SERVICES PROFESSIONNELS	1,89 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,45 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	1,13 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	1,09 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,91 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,83 %
SECTEUR MARITIME	0,49 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,18 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,13 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,10 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	12,19 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	4,16 %
BOISSONS	2,62 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	2,61 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,02 %
TABAC	0,95 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,83 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	11,27 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	4,90 %
AUTOMOBILES	2,52 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,89 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	0,70 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	0,38 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,29 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,29 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,26 %
DISTRIBUTEURS	0,04 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	6,90 %
SEMI-CONDUCTEURS	3,87 %
LOGICIELS	1,99 %
SERVICES INFORMATIQUES	0,45 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,36 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	0,19 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,04 %

MATÉRIAUX	6,86 %
PRODUITS CHIMIQUES	3,24 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	2,20 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,98 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,24 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,20 %
ÉNERGIE	5,84 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	5,84 %
SERVICES PUBLICS	4,18 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	2,36 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	1,42 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,22 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,17 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,00 %
SERVICES DE COMMUNICATION	3,11 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	2,12 %
MÉDIAS	0,55 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	0,36 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,09 %
IMMOBILIER	0,69 %
REIT DE BUREAUX	0,46 %
REIT COMMERCIAUX	0,13 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,10 %
REIT DIVERSIFIÉS	0,01 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

● Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

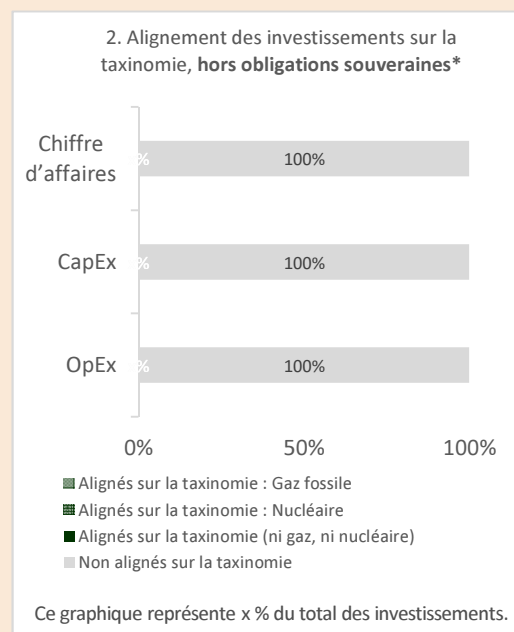
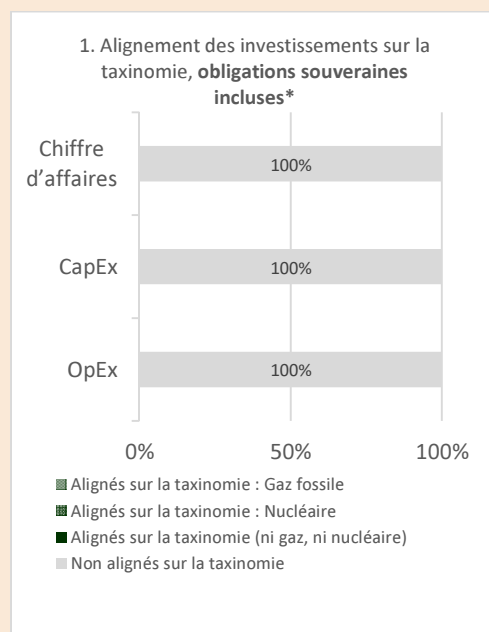
- Oui :
 En gaz fossile En énergie nucléaire
 Non

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.

représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,58 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Dans le cadre de la mise en œuvre de sa Politique d'investissement, le Compartiment sélectionne principalement ses titres parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres ont été exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment a éliminé les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300XZM86DVF3FTG61

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Oui	<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Compartiment State Street North America ESG Screened Enhanced Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à surperformer l'indice MSCI North America Index (l'« Indice ») sur le moyen et long terme tout en excluant des titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte anti-corruption et les armes controversées.

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille tout au long de la période pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
APPLE INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	6,56 %	ÉTATS-UNIS
MICROSOFT CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	5,31 %	ÉTATS-UNIS
AMAZON.COM INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,68 %	ÉTATS-UNIS
NVIDIA CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,60 %	ÉTATS-UNIS
META PLATFORMS INC CLASS A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,81 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,69 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL C	SERVICES DE COMMUNICATION	1,53 %	ÉTATS-UNIS
TESLA INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,35 %	ÉTATS-UNIS
EXXON MOBIL CORP	ÉNERGIE	1,35 %	ÉTATS-UNIS
JPMORGAN CHASE + CO	FINANCES	1,33 %	ÉTATS-UNIS
UNITEDHEALTH GROUP INC	SOINS DE SANTÉ	1,28 %	ÉTATS-UNIS
BROADCOM INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,16 %	ÉTATS-UNIS
PROCTER + GAMBLE CO/THE	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,14 %	ÉTATS-UNIS
MERCK + CO. INC.	SOINS DE SANTÉ	0,94 %	ÉTATS-UNIS
PEPSICO INC	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,86 %	ÉTATS-UNIS

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

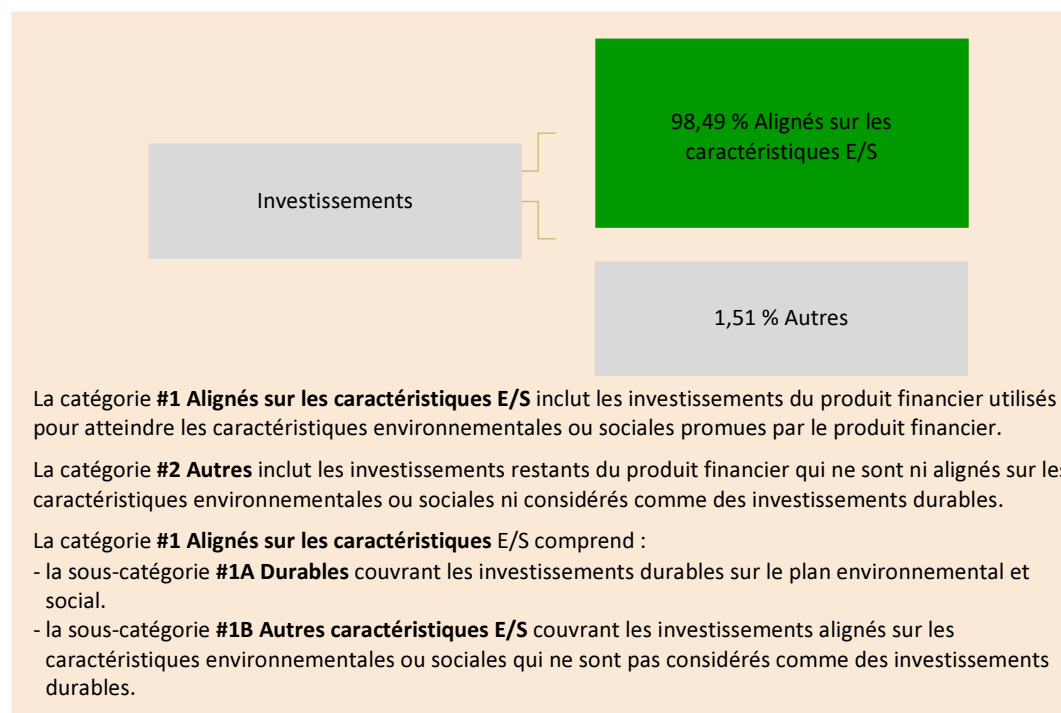
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?



Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

98,49 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,51 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	26,61 %
LOGICIELS	9,75 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	7,23 %
SEMI-CONDUCTEURS	6,67 %
SERVICES INFORMATIQUES	1,60 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,84 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,52 %
FINANCES	13,00 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

BANQUES	3,72 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	3,07 %
ASSURANCE	2,41 %
SERVICES FINANCIERS	2,27 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,09 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,43 %
SOINS DE SANTÉ	12,47 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	3,71 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	2,71 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,52 %
BIOTECHNOLOGIE	2,12 %
SCIENCES DE LA VIE	1,40 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	10,34 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	3,16 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	2,07 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	1,87 %
AUTOMOBILES	1,87 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	0,44 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,42 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,21 %
DISTRIBUTEURS	0,15 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,09 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,06 %
INDUSTRIES	9,17 %
MACHINES-OUTILS	1,76 %

AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	1,45 %
ROUTE ET RAIL	1,22 %
SERVICES PROFESSIONNELS	1,00 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	0,67 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	0,65 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,63 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,58 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,58 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,46 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,17 %
SERVICES DE COMMUNICATION	8,15 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	5,05 %
DIVERTISSEMENTS	1,20 %
MÉDIAS	0,89 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	0,68 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,34 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	6,08 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,87 %
BOISSONS	1,43 %
PRODUITS DOMESTIQUES	1,25 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	0,98 %
TABAC	0,49 %
PRODUITS DE SOINS PERSONNELS	0,03 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,02 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,02 %

ÉNERGIE	4,80 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	4,51 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,29 %
MATÉRIAUX	2,81 %
PRODUITS CHIMIQUES	1,60 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	0,90 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,27 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,03 %
SERVICES PUBLICS	2,35 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,50 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,73 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,11 %
IMMOBILIER	2,31 %
REIT SPÉCIALISÉS	1,09 %
REIT COMMERCIAUX	0,47 %
REIT RÉSIDENTIELS	0,25 %
REIT INDUSTRIELS	0,20 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,14 %
REIT – HÔTELS ET COMPLEXES HÔTELIERS	0,09 %
REIT – SANTÉ	0,06 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

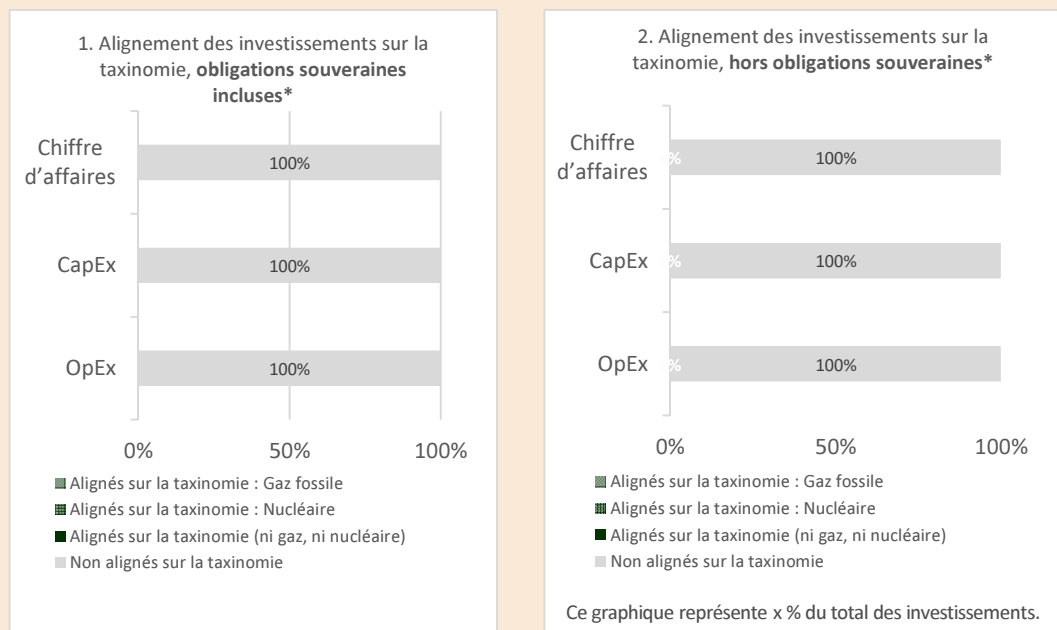
● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

Oui :

En gaz fossile En énergie nucléaire

Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,51 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Dans le cadre de la mise en œuvre de sa Politique d'investissement, le Compartiment sélectionne principalement ses titres parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres ont été exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier.

Le Compartiment a éliminé les titres identifiés comme non conformes aux principes du PMNU concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300RJWR8TQWG0T308

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : _____%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : _____%

Non

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il **promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Compartiment State Street Global ESG Screened Enhanced Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à surperformer l'indice MSCI World Index (l'« Indice ») sur le moyen et long terme tout en excluant des titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte anti-corruption et les armes controversées.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.



Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille tout au long de la période pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
APPLE INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	4,87 %	ÉTATS-UNIS
MICROSOFT CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	3,96 %	ÉTATS-UNIS
AMAZON.COM INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,04 %	ÉTATS-UNIS
NVIDIA CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,78 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,31 %	ÉTATS-UNIS
META PLATFORMS INC CLASS A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,21 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL C	SERVICES DE COMMUNICATION	1,19 %	ÉTATS-UNIS
TESLA INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,07 %	ÉTATS-UNIS
EXXON MOBIL CORP	ÉNERGIE	0,88 %	ÉTATS-UNIS
UNITEDHEALTH GROUP INC	SOINS DE SANTÉ	0,84 %	ÉTATS-UNIS
JPMORGAN CHASE + CO	FINANCES	0,82 %	ÉTATS-UNIS
BROADCOM INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,74 %	ÉTATS-UNIS
PROCTER + GAMBLE CO/THE	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,72 %	ÉTATS-UNIS
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	FINANCES	0,66 %	ÉTATS-UNIS
VISA INC CLASS A SHARES	FINANCES	0,62 %	ÉTATS-UNIS

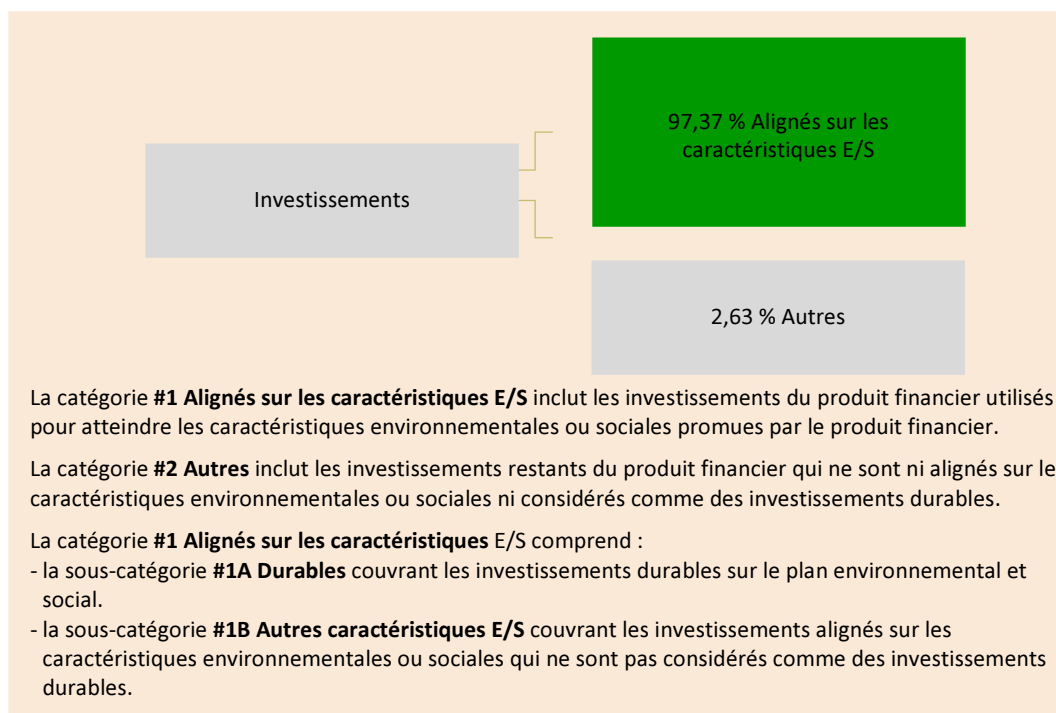
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

97,37 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 2,63 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	21,60 %
LOGICIELS	7,54 %
SEMI-CONDUCTEURS	5,81 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	5,37 %
SERVICES INFORMATIQUES	1,47 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,74 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,66 %
FINANCES	14,42 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

BANQUES	5,28 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	3,00 %
ASSURANCE	2,99 %
SERVICES FINANCIERS	1,50 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,27 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,37 %
SOINS DE SANTÉ	12,63 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	5,19 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,40 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	2,07 %
BIOTECHNOLOGIE	1,83 %
SCIENCES DE LA VIE	1,13 %
TECHNOLOGIE DES SOINS DE SANTÉ	0,02 %
INDUSTRIES	10,92 %
MACHINES-OUTILS	2,01 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	1,47 %
SERVICES PROFESSIONNELS	1,08 %
ROUTE ET RAIL	1,06 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,00 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	0,94 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,84 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,77 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,61 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,57 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,34 %
SECTEUR MARITIME	0,19 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,03 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,00 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	10,78 %
AUTOMOBILES	2,36 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	2,34 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,95 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	1,55 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	1,20 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,67 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,34 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,15 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,11 %
DISTRIBUTEURS	0,10 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	7,07 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,69 %
BOISSONS	1,55 %

PRODUITS ALIMENTAIRES	1,51 %
PRODUITS DOMESTIQUES	1,09 %
TABAC	0,59 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,53 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,08 %
PRODUITS DE SOINS PERSONNELS	0,02 %
SERVICES DE COMMUNICATION	7,01 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	3,76 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	1,07 %
DIVERTISSEMENTS	1,03 %
MÉDIAS	0,78 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,37 %
ÉNERGIE	4,62 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	4,45 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,18 %
MATÉRIAUX	4,10 %
PRODUITS CHIMIQUES	1,93 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	1,60 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,38 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,20 %
SERVICES PUBLICS	2,60 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,54 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,81 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,21 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,04 %
IMMOBILIER	2,30 %
REIT SPÉCIALISÉS	0,62 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,49 %
REIT COMMERCIAUX	0,42 %
REIT INDUSTRIELS	0,22 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,21 %
REIT RÉSIDENTIELS	0,15 %
REIT DE BUREAUX	0,09 %
REIT – HÔTELS ET COMPLEXES HÔTELIERS	0,06 %
REIT – SANTÉ	0,05 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

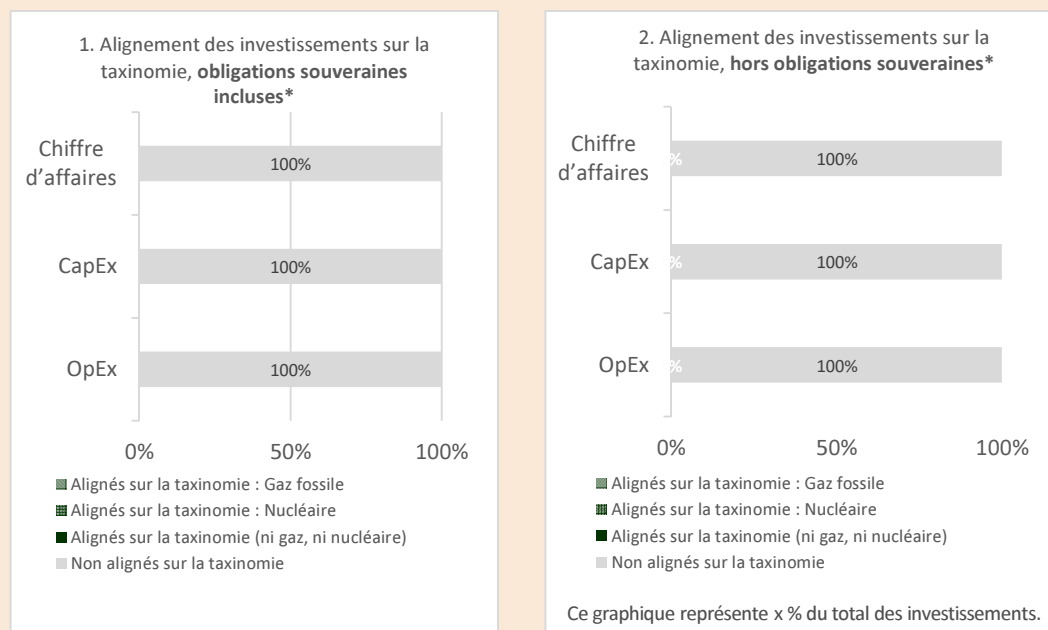
● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

Oui :

En gaz fossile En énergie nucléaire

Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*




* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 2,63 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Dans le cadre de la mise en œuvre de sa Politique d'investissement, le Compartiment sélectionne principalement ses titres parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue.

En conséquence, les titres ont été exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment a éliminé les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Sustainable Climate Emerging Markets Enhanced Equity Fund
Identifiant d'entité juridique : 549300IUS0N9P4G0A187

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Oui	<input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de 25 % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment promeut certaines caractéristiques environnementales au moyen de placements dans des sociétés qui affichent une empreinte carbone plus faible en termes d'émissions actuelles et futures (mesurées par les réserves de combustibles fossiles), qui génèrent des revenus verts et qui sont mieux positionnées pour faire face aux risques physiques posés par le changement climatique.

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

En outre, d'autres caractéristiques environnementales et sociales sont promues au moyen d'un filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille du Compartiment pour éliminer les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale et sociale. Plus précisément, le Compartiment promeut certaines caractéristiques sociales en excluant les investissements dans des sociétés qui violent les principes du PMNU relatifs aux droits de l'homme (Principes 1 et 2), aux normes de travail (Principes 3 à 6) et à la lutte contre la corruption (Principe 10) et des sociétés impliquées dans les secteurs du tabac, de l'alcool, du divertissement pour adultes, des jeux d'argent et des armes controversées. Les principes du PMNU représentent l'initiative mondiale la plus importante en matière de durabilité, lancée afin que les sociétés alignent leurs stratégies et opérations sur les principes universels en matière de droits de l'homme, de travail, d'environnement et de lutte contre la corruption et prennent des mesures qui fassent avancer les objectifs sociétaux.

Le Compartiment peut utiliser des filtres ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure les titres sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs de ces critères ESG.

Le Compartiment promeut en outre certaines caractéristiques environnementales et sociales en allouant une portion de son portefeuille à des investissements durables. Pour être qualifié d'investissement durable, le titre investi doit être émis par une « Société dominante » ou une « Société surperformante » tel que déterminé par le Gestionnaire financier à l'aide du score R-FactorTM ESG.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales est mesurée par l'exposition plus élevée du portefeuille du Compartiment (par rapport à l'indice MSCI Emerging Markets Index (l'« Indice »)) aux sociétés qui atténuent les émissions de gaz à effet de serre et s'adaptent aux risques liés au climat.

La réduction de l'Intensité des émissions de carbone par rapport à celle de l'Indice est de 60 %

La réduction des Réserves de combustibles fossiles par rapport à celles de l'Indice est de 88 %

La réduction des revenus bruns par rapport à ceux de l'Indice est de 52 %

L'augmentation des revenus verts par rapport à ceux de l'Indice est de 101 %

La réalisation effective des caractéristiques environnementales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. La réalisation des caractéristiques sociales est mesurée à travers un pourcentage nul du portefeuille investi en titres qui violent les Principes du PMNU et de sociétés impliquées dans le secteur des armes controversées.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Les objectifs visés par les investissements durables du Compartiment consistent à investir dans des titres de sociétés classées comme : « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » d'après le score ESG généré par le système de notation ESG interne du Gestionnaire financier.

Le système de notation ESG mis au point par le Gestionnaire financier exploite de multiples sources de données et les aligne sur des cadres de matérialité transparents et largement reconnus, de manière à générer un score ESG unique pour les sociétés cotées. Il mesure la performance des opérations commerciales et de la gouvernance d'une société du fait qu'il reprend les défis ESG importants sur le plan financier relevés par le secteur d'activité de la société.

Les sociétés qualifiées de « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » par le Gestionnaire financier à l'aide du score ESG généré dans le cadre d'un processus de notation interne sont réputées être meilleures que leurs homologues du secteur dans la gestion et la limitation à long terme des risques en matière de durabilité importants sur le plan financier et donc, l'exploitation d'un modèle d'activité plus durable.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le Gestionnaire financier applique au Compartiment un filtre ESG négatif et basé sur des normes, afin d'exclure certaines sociétés sur la base d'une évaluation leur adhésion à des critères ESG donnés, en ce compris des sociétés identifiées comme contrevenant aux Principes du PMNU relatifs aux domaines suivants : protection environnementale, droits de l'homme, normes de travail, lutte contre la corruption et armes controversées. L'application du filtre ESG négatif et basé sur des normes en question permet au Gestionnaire financier de juger si les investissements durables du Compartiment causent un préjudice important à l'un quelconque des objectifs d'investissement durable environnementaux ou sociaux visés par ce dernier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment examine les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans le cadre de la Stratégie en actions Climat durable et en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Plus précisément, le Compartiment prend en considération

- les émissions de gaz à effet de serre
- l’empreinte carbone
- l’intensité des gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements
- l’exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- la part de consommation et de production d’énergie non renouvelable
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l’exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

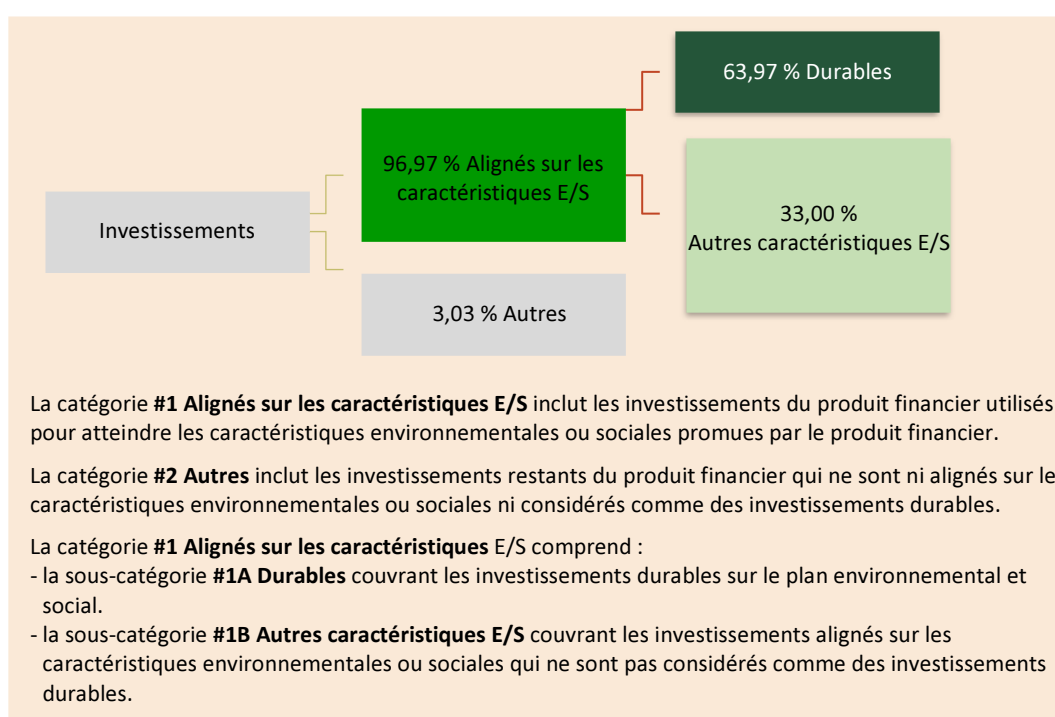
Investissements les plus importants	Secteur	% d’actifs	Pays
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	6,62 %	TAÏWAN
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	3,95 %	RÉPUBLIQUE DE CORÉE
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,69 %	CHINE
MEITUAN CLASS B	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,00 %	HONG KONG
INFOSYS LTD SP ADR	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	0,99 %	INDE
NETEASE INC	SERVICES DE COMMUNICATION	0,87 %	HONG KONG
JD.COM INC CL A	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	0,82 %	HONG KONG
HON HAI PRECISION INDUSTRY	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	0,79 %	TAÏWAN
PING AN INSURANCE GROUP CO H	FINANCES	0,78 %	CHINE
CHINA CONSTRUCTION BANK H	FINANCES	0,77 %	CHINE
PDD HOLDINGS INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	0,76 %	ÉTATS-UNIS
RELIANCE INDUSTRIES LTD	ÉNERGIE	0,74 %	INDE
MEDIATEK INC	TECHNOLOGIES DE L’INFORMATION	0,73 %	TAÏWAN
ICICI BANK LTD	FINANCES	0,69 %	INDE
PETROBRAS PETROLEO BRAS PR	ÉNERGIE	0,66 %	BRÉSIL

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

La part du Fonds investie en Investissements durables était de 63,97 % à la fin de l'exercice.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

96,97 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », 63,97 % étant des investissements durables comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 3,03 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

FINANCES	21,12 %
BANQUES	15,39 %
ASSURANCE	2,88 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,55 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	0,81 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,47 %
SERVICES FINANCIERS	0,03 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	20,61 %

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

SEMI-CONDUCTEURS	9,48 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	5,98 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	2,63 %
SERVICES INFORMATIQUES	2,34 %
LOGICIELS	0,10 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,09 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	13,25 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	4,80 %
AUTOMOBILES	3,06 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	2,19 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	0,83 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,79 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	0,57 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,56 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,30 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,13 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,02 %
SERVICES DE COMMUNICATION	9,31 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	4,75 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	1,77 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	1,42 %
DIVERTISSEMENTS	1,32 %
MÉDIAS	0,05 %
MATÉRIAUX	7,44 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	3,52 %
PRODUITS CHIMIQUES	2,76 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,78 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,27 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,11 %
INDUSTRIES	6,13 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	1,43 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,11 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,69 %
MACHINES-OUTILS	0,68 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,48 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,31 %
ROUTE ET RAIL	0,30 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,30 %
SECTEUR MARITIME	0,23 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,17 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,17 %

SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,15 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,12 %
SERVICES PROFESSIONNELS	0,01 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	5,73 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	2,17 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	1,17 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,02 %
BOISSONS	1,01 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,24 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,13 %
ÉNERGIE	4,65 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	4,54 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,11 %
SOINS DE SANTÉ	3,66 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	1,44 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	0,98 %
SCIENCES DE LA VIE	0,54 %
BIOTECHNOLOGIE	0,51 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	0,19 %
SERVICES PUBLICS	2,73 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	0,93 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,89 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,66 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,25 %
IMMOBILIER	1,85 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	1,54 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,30 %
REIT DE BUREAUX	0,01 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

- **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

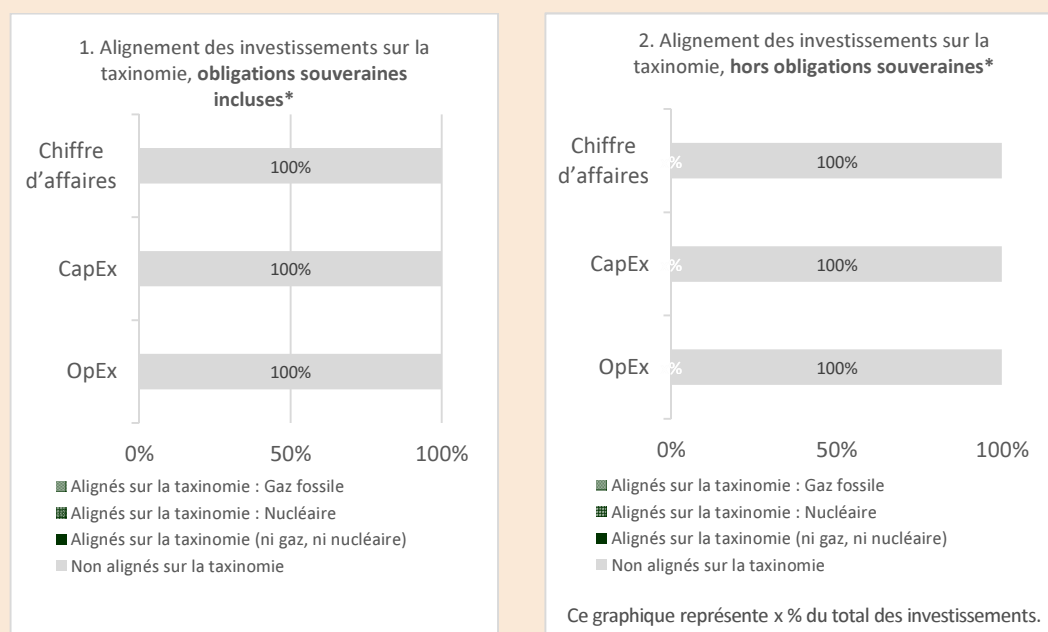
¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

- Oui :
- En gaz fossile En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.


● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.

● **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif environnemental, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif social, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 3,03 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Cette stratégie utilise des modèles quantitatifs d'allocation par pays, de sélection de titres et multifactoriels pour évaluer l'attractivité des valeurs, en ce compris l'utilisation d'une méthodologie systématique pour offrir une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux sociétés qui réduisent les risques liés au climat et s'y adaptent.

Pour instaurer cette stratégie, le Gestionnaire financier construit un portefeuille de titres en tenant compte de certains facteurs ESG tels que : l'intensité carbone (émissions proportionnelles au chiffre d'affaires), les réserves de combustibles fossiles, les revenus verts, les revenus bruns et les notations en matière d'adaptation au climat. Le portefeuille qui en résulte entend offrir une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux sociétés qui réduisent et s'adaptent aux risques liés au climat. Les titres du Compartiment sont sélectionnés principalement parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue.

L'application des filtres ESG conduit à l'exclusion des titres du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment éliminera les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que le tabac, l'alcool, le divertissement pour adultes, les jeux d'argent et les armes controversées.

Le Compartiment peut utiliser des techniques d'examen ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure les titres sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs des critères ESG mentionnés dans la phrase précédente.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund
 Identifiant d'entité juridique : 549300LBU31V51ZZ5J65

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____%



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%



Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Compartiment State Street Emerging Markets ESG Screened Enhanced Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à surperformer l'indice MSCI Emerging Markets Index (l'« Indice ») sur le moyen et long terme tout en excluant des titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte anti-corruption et les armes controversées.

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille tout au long de la période pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

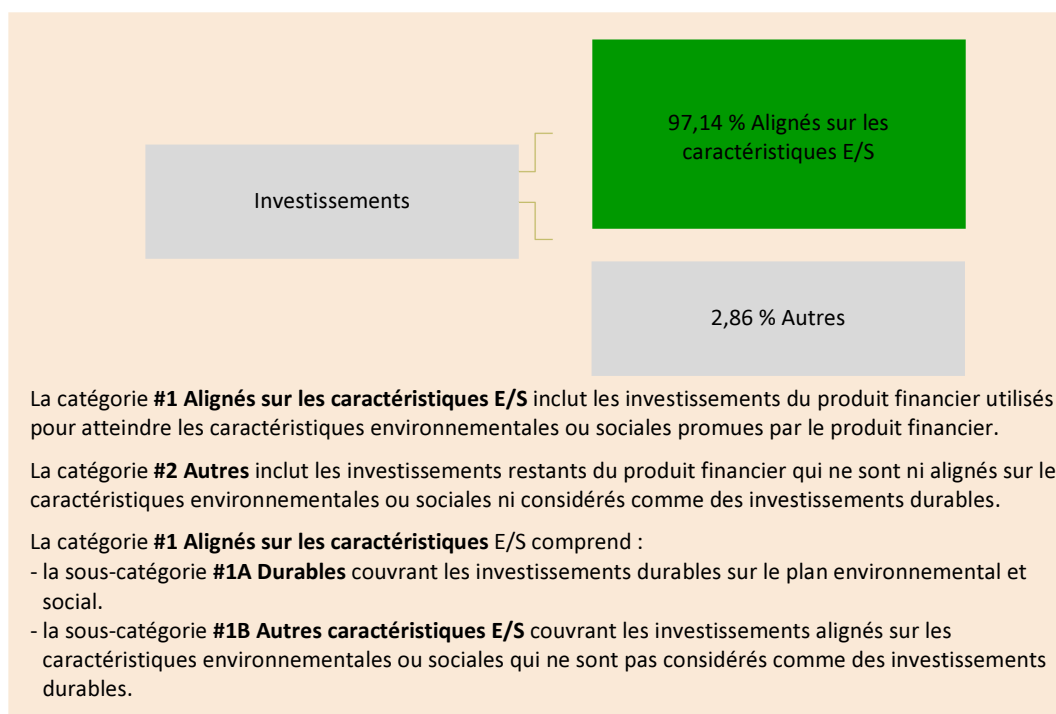
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	6,54 %	TAÏWAN
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	3,88 %	RÉPUBLIQUE DE CORÉE
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,59 %	CHINE
RELIANCE INDUSTRIES LTD	ÉNERGIE	1,13 %	INDE
MEITUAN CLASS B	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,06 %	HONG KONG
INFOSYS LTD SP ADR	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,98 %	INDE
PDD HOLDINGS INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	0,86 %	ÉTATS-UNIS
CHINA CONSTRUCTION BANK H	FINANCES	0,80 %	CHINE
HON HAI PRECISION INDUSTRY	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,75 %	TAÏWAN
MEDIATEK INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,74 %	TAÏWAN
NETEASE INC	SERVICES DE COMMUNICATION	0,73 %	HONG KONG
PING AN INSURANCE GROUP CO H	FINANCES	0,70 %	CHINE
JD.COM INC CL A	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	0,70 %	HONG KONG
NAVER CORP	SERVICES DE COMMUNICATION	0,69 %	RÉPUBLIQUE DE CORÉE
SK HYNIX INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,68 %	RÉPUBLIQUE DE CORÉE

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

97,14 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 2,86 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

FINANCES	21,17 %
BANQUES	14,98 %
ASSURANCE	2,85 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,67 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	0,94 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,70 %
SERVICES FINANCIERS	0,04 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	20,80 %

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

SEMI-CONDUCTEURS	9,54 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	6,09 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	2,61 %
SERVICES INFORMATIQUES	2,02 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,43 %
LOGICIELS	0,12 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	13,06 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	4,70 %
AUTOMOBILES	2,88 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	2,26 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	0,88 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,69 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	0,57 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,45 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,27 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,27 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,05 %
PIÈCES AUTOMOBILES	0,02 %
DISTRIBUTEURS	0,01 %
SERVICES DE COMMUNICATION	9,33 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	4,48 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	1,65 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	1,49 %
DIVERTISSEMENTS	1,48 %
MÉDIAS	0,23 %
MATÉRIAUX	7,64 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	3,81 %
PRODUITS CHIMIQUES	2,72 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,78 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,18 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,15 %
INDUSTRIES	6,22 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,40 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	1,11 %
MACHINES-OUTILS	0,75 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,53 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,49 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,47 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,42 %
SECTEUR MARITIME	0,33 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,24 %

COMPAGNIES AÉRIENNES	0,23 %
ROUTE ET RAIL	0,16 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,06 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,03 %
SERVICES PROFESSIONNELS	0,01 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	5,88 %
BOISSONS	1,87 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	1,52 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,12 %
TABAC	0,57 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,52 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,19 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,10 %
ÉNERGIE	4,74 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	4,67 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,07 %
SOINS DE SANTÉ	3,74 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	1,45 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	0,98 %
SCIENCES DE LA VIE	0,56 %
BIOTECHNOLOGIE	0,55 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	0,21 %
SERVICES PUBLICS	2,80 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,30 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,76 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,68 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,05 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,01 %
IMMOBILIER	1,62 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	1,32 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,27 %
REIT INDUSTRIELS	0,02 %
REIT COMMERCIAUX	0,01 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

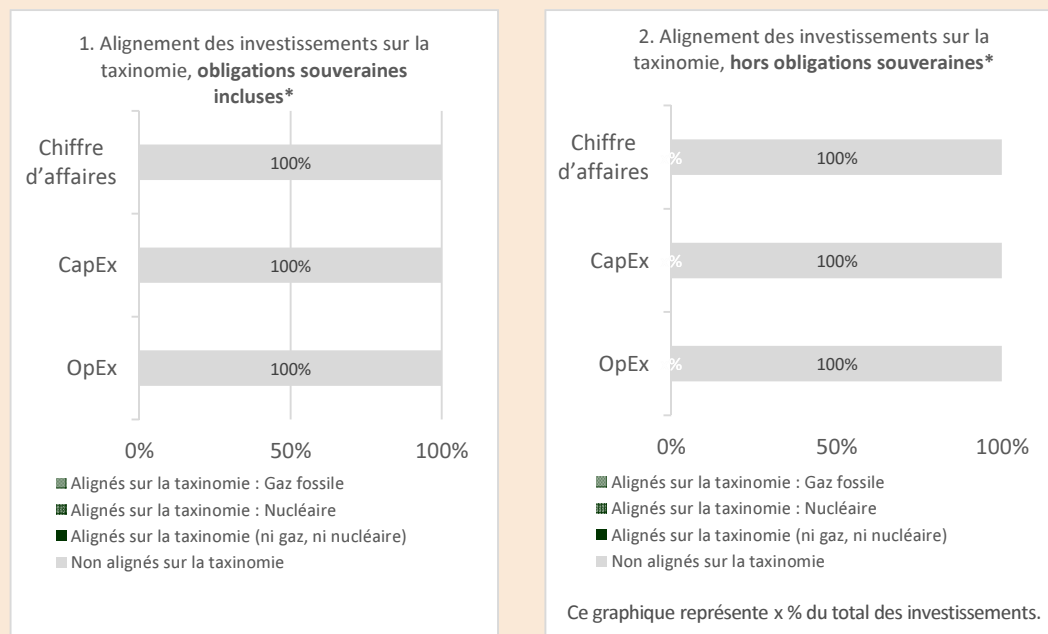
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
- En gaz fossile En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*




* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 2,86 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Dans le cadre de la mise en œuvre de sa Politique d'investissement, le Compartiment sélectionne principalement ses titres parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres ont été exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier.

Le Compartiment a éliminé les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street EMU ESG Screened Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300YX23AKKOP3RQ65

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Compartiment State Street EMU ESG Screened Enhanced Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à surperformer l'indice MSCI EMU Index (l'« Indice ») sur le moyen et long terme tout en excluant des titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte anti-corruption et les armes controversées.



Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**.

Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille tout au long de la période pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

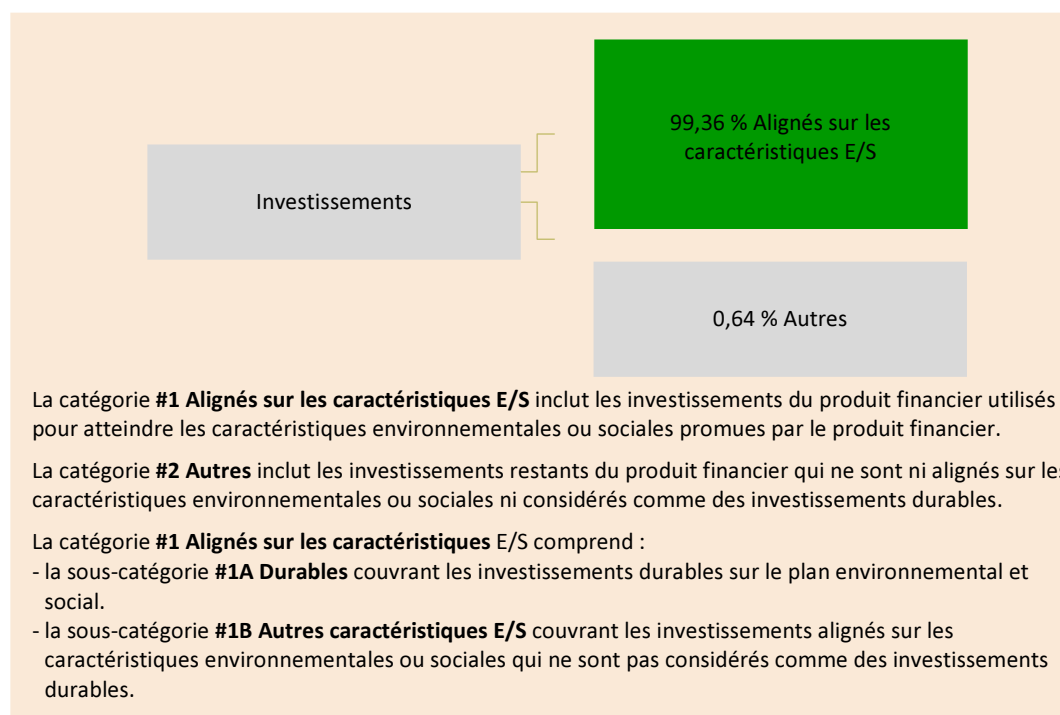
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
SANOFI	SOINS DE SANTÉ	3,79 %	FRANCE
ASML HOLDING NV	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	3,77 %	PAYS-BAS
TOTALENERGIES SE	ÉNERGIE	3,23 %	FRANCE
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	3,00 %	FRANCE
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	FINANCES	2,47 %	ESPAGNE
UNICREDIT SPA	FINANCES	2,35 %	ITALIE
ING GROEP NV	FINANCES	2,30 %	PAYS-BAS
STELLANTIS NV	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,27 %	PAYS-BAS
DEUTSCHE TELEKOM AG REG	SERVICES DE COMMUNICATION	2,22 %	ALLEMAGNE
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,17 %	ALLEMAGNE
STMICROELECTRONICS NV	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,13 %	PAYS-BAS
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	INDUSTRIES	2,09 %	FRANCE
SAP SE	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,99 %	ALLEMAGNE
MICHELIN (CGDE)	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,96 %	FRANCE
ENGIE	SERVICES PUBLICS	1,86 %	FRANCE

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,36 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,64 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

FINANCES	17,92 %
BANQUES	11,29 %
ASSURANCE	4,21 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	2,04 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	0,38 %
INDUSTRIES	16,51 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	3,86 %
MACHINES-OUTILS	2,53 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	2,15 %

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

SERVICES PROFESSIONNELS	1,92 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	1,42 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	1,29 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,23 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	1,13 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	0,50 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,48 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	16,03 %
AUTOMOBILES	6,52 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	4,45 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	1,65 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	1,58 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,45 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,10 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,09 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,09 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	0,09 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	12,17 %
SEMI-CONDUCTEURS	7,21 %
LOGICIELS	2,69 %
SERVICES INFORMATIQUES	1,68 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,40 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	0,11 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,08 %
SOINS DE SANTÉ	8,03 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	5,25 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	2,05 %
SCIENCES DE LA VIE	0,45 %
TECHNOLOGIE DES SOINS DE SANTÉ	0,14 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	0,12 %
BIOTECHNOLOGIE	0,02 %
MATÉRIAUX	7,00 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	2,15 %
PRODUITS CHIMIQUES	2,09 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	2,04 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,63 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,08 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	6,43 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	3,52 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	1,21 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	0,88 %

BOISSONS	0,81 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,01 %
SERVICES DE COMMUNICATION	5,40 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	3,67 %
MÉDIAS	1,73 %
SERVICES PUBLICS	4,76 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	3,12 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,42 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,15 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,07 %
ÉNERGIE	4,20 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	3,85 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,35 %
IMMOBILIER	0,32 %
REIT COMMERCIAUX	0,17 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,08 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,06 %
REIT DE BUREAUX	0,01 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

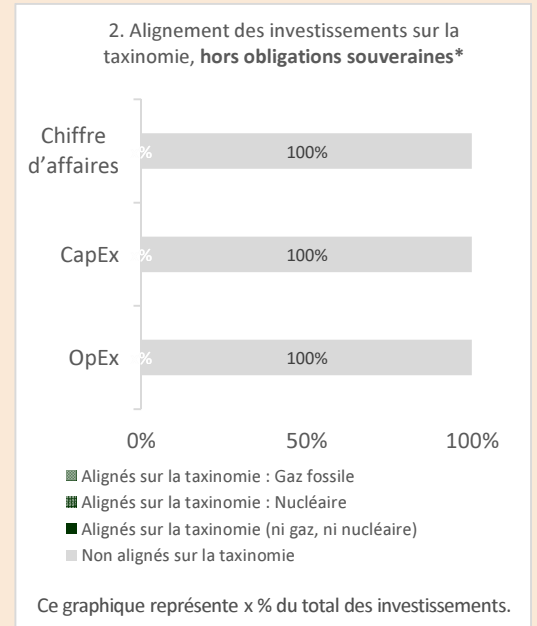
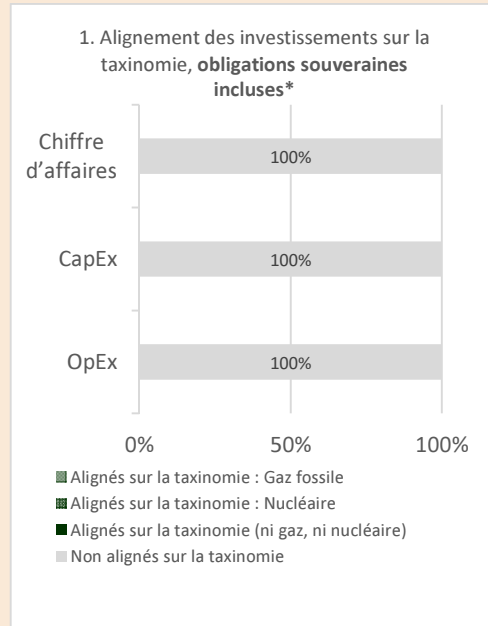
- Oui :
- En gaz fossile En énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,64 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Dans le cadre de la mise en œuvre de sa Politique d'investissement, le Compartiment sélectionne principalement ses titres parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres ont été exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment a éliminé les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Europe Small Cap ESG Screened Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 5493004X5UEROS74CB07

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____%</p> <p><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p>	<p><input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.</p> <p><input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> ayant un objectif social</p>
<p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables</p>

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Compartiment State Street Europe Small Cap ESG Screened Enhanced Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à surperformer l'indice MSCI Europe Small Cap Index (l'« Indice ») sur le moyen et long terme tout en excluant des titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte anti-corruption et les armes controversées.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille tout au long de la période pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?



La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
REXEL SA	INDUSTRIES	1,48 %	FRANCE
HOWDEN JOINERY GROUP PLC	INDUSTRIES	1,40 %	ROYAUME-UNI
TRELLEBORG AB B SHS	INDUSTRIES	1,34 %	SUÈDE
SPECTRIS PLC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,26 %	ROYAUME-UNI
GRAFTON GROUP PLC UTS CDI	INDUSTRIES	1,19 %	IRLANDE
SYDBANK A/S	FINANCES	1,18 %	DANEMARK
A2A SPA	SERVICES PUBLICS	1,18 %	ITALIE
WIHLBORGS FASTIGHETER AB	IMMOBILIER	1,18 %	SUÈDE
BALFOUR BEATTY PLC	INDUSTRIES	1,17 %	ROYAUME-UNI
TIETOEVRV OYJ	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,16 %	FINLANDE
INCHCAPE PLC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,14 %	ROYAUME-UNI
IPSOS	SERVICES DE COMMUNICATION	1,14 %	FRANCE
ARYZTA AG	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,13 %	SUISSE
LOOMIS AB	INDUSTRIES	1,12 %	SUÈDE
MITIE GROUP PLC	INDUSTRIES	1,12 %	ROYAUME-UNI

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

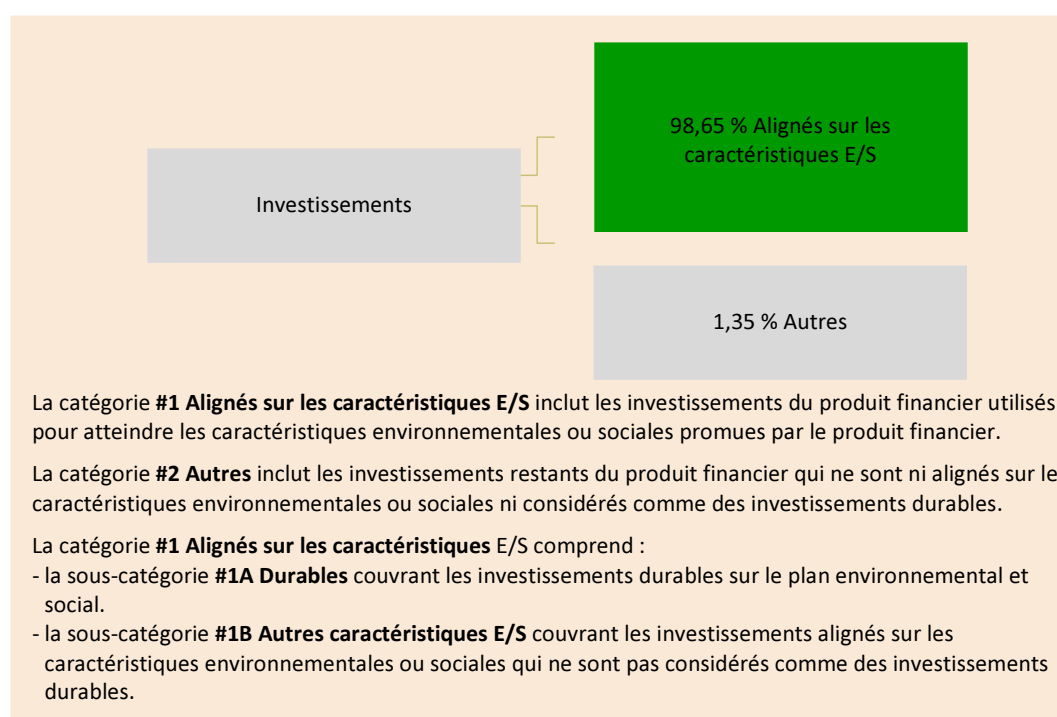


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

98,65 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,35 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

INDUSTRIES	26,63 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	5,12 %
MACHINES-OUTILS	5,09 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	4,23 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	3,81 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	2,70 %
SECTEUR MARITIME	1,89 %
ROUTE ET RAIL	1,70 %
SERVICES PROFESSIONNELS	0,67 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

COMPAGNIES AÉRIENNES	0,57 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,50 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	0,36 %
FINANCES	15,61 %
BANQUES	5,50 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	4,25 %
ASSURANCE	2,50 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,87 %
SERVICES FINANCIERS	1,42 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,07 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	11,71 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	3,01 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	2,95 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	2,21 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	1,15 %
DISTRIBUTEURS	1,14 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,58 %
AUTOMOBILES	0,37 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,26 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,06 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	10,07 %
SERVICES INFORMATIQUES	2,66 %
SEMI-CONDUCTEURS	2,37 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	2,30 %
LOGICIELS	1,32 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,79 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	0,62 %
MATÉRIAUX	8,63 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	3,73 %
PRODUITS CHIMIQUES	2,35 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	1,84 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,71 %
IMMOBILIER	7,38 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	3,89 %
REIT COMMERCIAUX	2,15 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	1,06 %
REIT DE BUREAUX	0,26 %
REIT RÉSIDENTIELS	0,01 %
SOINS DE SANTÉ	7,05 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	3,25 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	1,50 %

SCIENCES DE LA VIE	1,07 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	1,04 %
TECHNOLOGIE DES SOINS DE SANTÉ	0,13 %
BIOTECHNOLOGIE	0,06 %
SERVICES DE COMMUNICATION	3,89 %
MÉDIAS	1,97 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	0,96 %
DIVERTISSEMENTS	0,57 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	0,38 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,02 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	3,56 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	1,60 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,21 %
BOISSONS	0,75 %
ÉNERGIE	2,52 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	1,33 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	1,18 %
SERVICES PUBLICS	1,95 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	1,64 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	0,18 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,14 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

- **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

Oui :


En gaz fossile En énergie nucléaire

Non

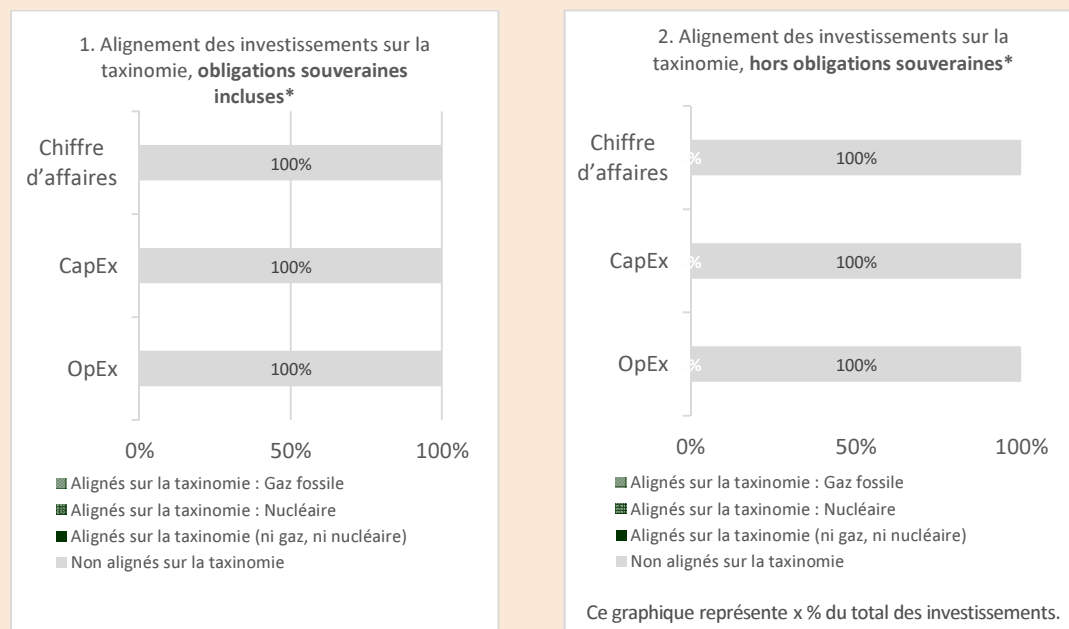
¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.**

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.

 **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,35 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Dans le cadre de la mise en œuvre de sa Politique d'investissement, le Compartiment sélectionne principalement ses titres parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres ont été exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment a éliminé les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300SXZY3ZL2ZGEW73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%

Non

Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Compartiment State Street Emerging Markets Small Cap ESG Screened Enhanced Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à surperformer l'indice MSCI Emerging Markets Small Cap Index (l'« Indice ») sur le moyen et long terme tout en excluant des titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte anti-corruption et les armes controversées.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille tout au long de la période pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

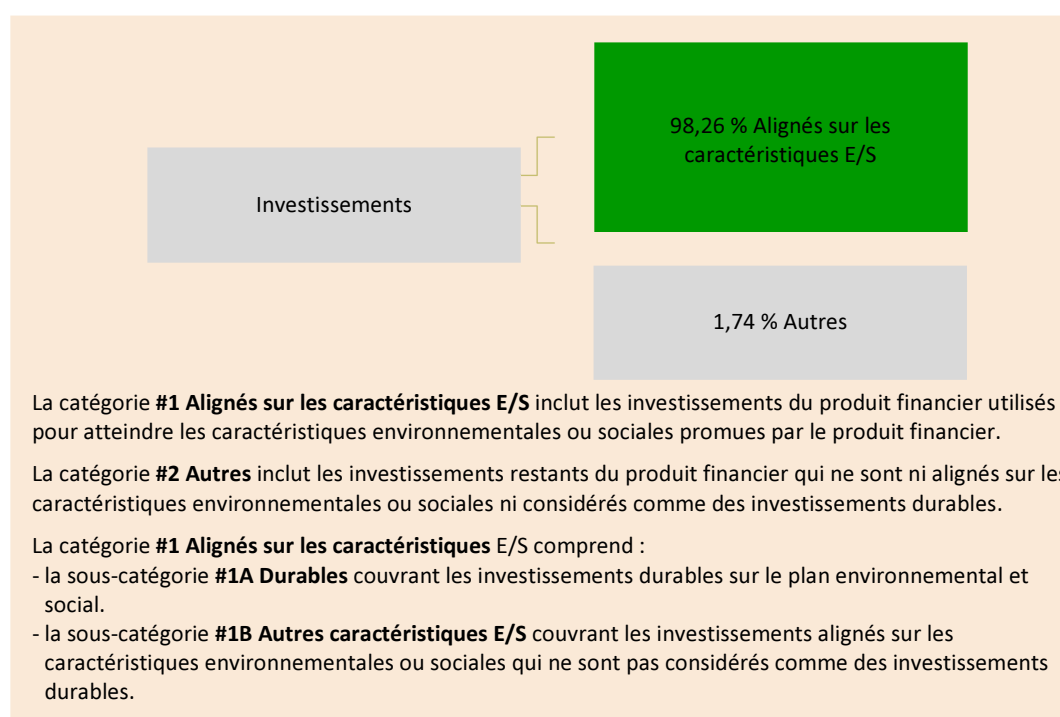
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
ISHARES MSCI EM SMALL CAP UCIT	COMMINGLED FUND	4,86 %	IRLANDE
TORRENT POWER LTD	SERVICES PUBLICS	1,04 %	INDE
APOLLO TYRES LTD	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,00 %	INDE
REC LTD	FINANCES	0,92 %	INDE
KING YUAN ELECTRONICS CO LTD	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,92 %	TAÏWAN
JB FINANCIAL GROUP CO LTD	FINANCES	0,91 %	RÉPUBLIQUE DE COREE
AKR CORPORINDO TBK PT	ÉNERGIE	0,89 %	INDONÉSIE
UNITED INTERNATIONAL TRANSPORT	INDUSTRIES	0,88 %	ARABIE SAOUDITE
TATA CHEMICALS LTD	MATÉRIAUX	0,85 %	INDE
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	0,84 %	AFRIQUE DU SUD
COMPEQ MANUFACTURING CO LTD	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,82 %	TAÏWAN
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	0,81 %	TAÏWAN
INTERNATIONAL GAMES SYSTEM C	SERVICES DE COMMUNICATION	0,80 %	TAÏWAN
TECO ELECTRIC + MACHINERY	INDUSTRIES	0,80 %	TAÏWAN
LIC HOUSING FINANCE LTD	FINANCES	0,79 %	INDE

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

98,26 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,74 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	19,01 %
SEMI-CONDUCTEURS	9,16 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	4,72 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	2,62 %
SERVICES INFORMATIQUES	1,24 %
LOGICIELS	0,92 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	0,35 %
INDUSTRIES	15,00 %

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

MACHINES-OUTILS	3,77 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	2,36 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	2,19 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,40 %
ROUTE ET RAIL	0,98 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,88 %
SECTEUR MARITIME	0,83 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,66 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,66 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,55 %
SERVICES PROFESSIONNELS	0,35 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,22 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,11 %
TRANSPORT TERRESTRE	0,04 %
MATÉRIAUX	11,32 %
PRODUITS CHIMIQUES	5,88 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	3,71 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,84 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,46 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,43 %
FINANCES	11,24 %
BANQUES	4,04 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	2,28 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	1,76 %
ASSURANCE	1,21 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	1,17 %
SERVICES FINANCIERS	0,79 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	10,58 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	3,57 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	2,19 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	1,87 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,81 %
AUTOMOBILES	0,64 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,62 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,39 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	0,31 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,19 %
SOINS DE SANTÉ	8,95 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	4,01 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	3,32 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	1,50 %
BIOTECHNOLOGIE	0,12 %

BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	5,29 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	2,85 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,09 %
BOISSONS	0,82 %
TABAC	0,26 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,24 %
PRODUITS DOMESTIQUES	0,03 %
IMMOBILIER	4,78 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	3,71 %
REIT INDUSTRIELS	0,55 %
REIT COMMERCIAUX	0,45 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,07 %
SERVICES PUBLICS	4,19 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,41 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	1,15 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,79 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,71 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,12 %
SERVICES DE COMMUNICATION	3,67 %
DIVERTISSEMENTS	1,24 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	1,11 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,71 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	0,33 %
MÉDIAS	0,28 %
ÉNERGIE	3,04 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	2,53 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,52 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie.

- **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

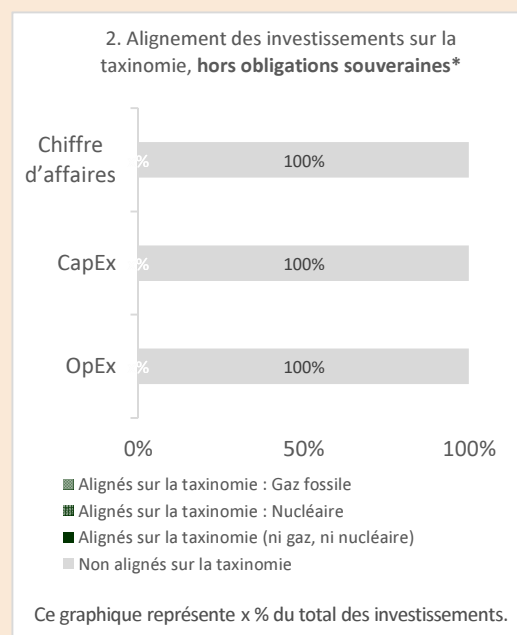
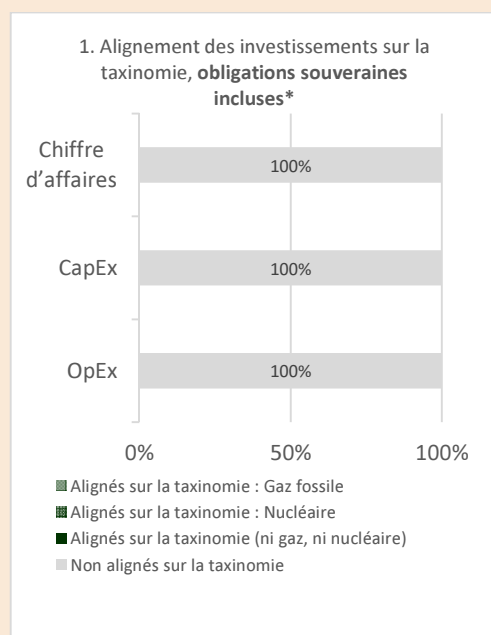
Oui :

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

En gaz fossile En énergie nucléaire

X Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du chiffre d'affaires pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- des dépenses d'investissement (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des dépenses d'exploitation (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,74 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Dans le cadre de la mise en œuvre de sa Politique d'investissement, le Compartiment sélectionne principalement ses titres parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres ont été exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment a éliminé les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300SR9616JQE7CE72

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : _____%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : _____%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il **promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Street Global ESG Screened Managed Volatility Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à surperformer l'indice MSCI World Index (l'« Indice ») sur le moyen et long terme tout en excluant des titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte anti-corruption et les armes controversées.



Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille tout au long de la période pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
PEPSICO INC	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,19 %	ÉTATS-UNIS
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	SOINS DE SANTÉ	1,15 %	ÉTATS-UNIS
OVERSEA CHINESE BANKING CORP	FINANCES	1,15 %	SINGAPOUR
T MOBILE US INC	SERVICES DE COMMUNICATION	1,11 %	ÉTATS-UNIS
CHURCH + DWIGHT CO INC	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,11 %	ÉTATS-UNIS
KIMBERLY CLARK CORP	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,10 %	ÉTATS-UNIS
MCDONALD S CORP	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,10 %	ÉTATS-UNIS
SOFTBANK CORP	SERVICES DE COMMUNICATION	1,10 %	JAPON
PROCTER + GAMBLE CO/THE	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,09 %	ÉTATS-UNIS
NOVARTIS AG REG	SOINS DE SANTÉ	1,07 %	SUISSE
BECTON DICKINSON AND CO	SOINS DE SANTÉ	1,07 %	ÉTATS-UNIS
EDISON INTERNATIONAL	SERVICES PUBLICS	1,07 %	ÉTATS-UNIS
KROGER CO	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,07 %	ÉTATS-UNIS
REGENERON PHARMACEUTICALS	SOINS DE SANTÉ	1,06 %	ÉTATS-UNIS
COLGATE PALMOLIVE CO	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,06 %	ÉTATS-UNIS

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

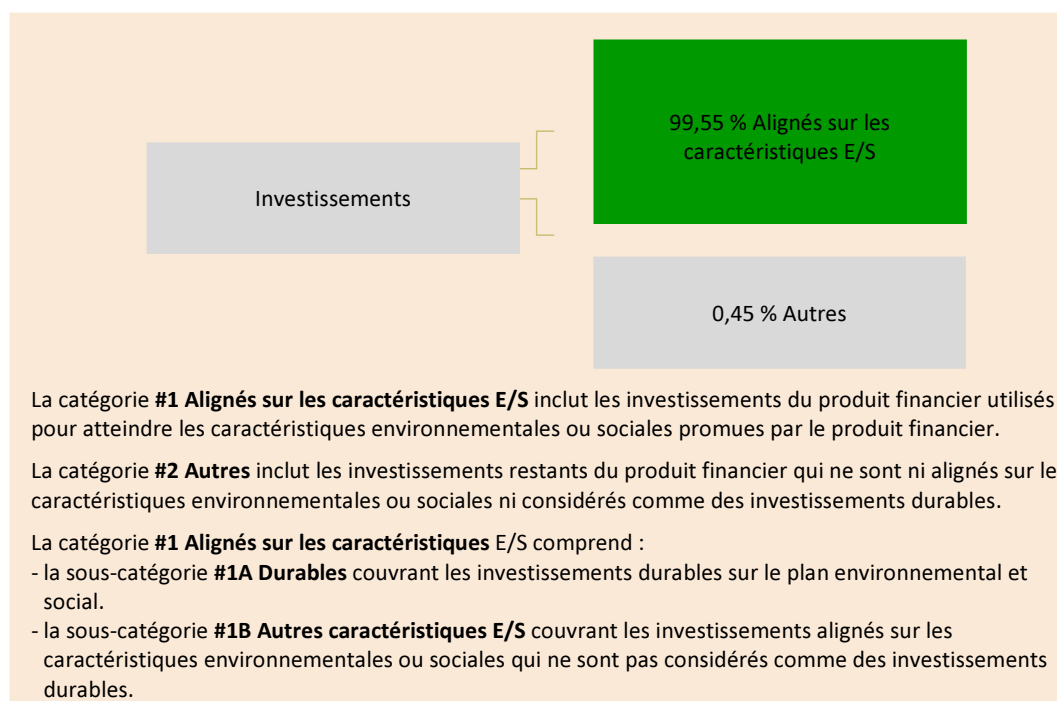


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,55 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,45 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	25,26 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	9,94 %
PRODUITS DOMESTIQUES	6,32 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	3,73 %
BOISSONS	2,27 %
TABAC	2,17 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,76 %
PRODUITS DE SOINS PERSONNELS	0,04 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,02 %
SOINS DE SANTÉ	24,28 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	9,15 %
BIOTECHNOLOGIE	8,50 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	5,28 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	1,34 %
SCIENCES DE LA VIE	0,01 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

SERVICES DE COMMUNICATION	14,84 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	9,57 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	3,28 %
DIVERTISSEMENTS	1,54 %
MÉDIAS	0,44 %
SERVICES PUBLICS	10,98 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	5,06 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	4,14 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	1,54 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,24 %
FINANCES	7,90 %
ASSURANCE	3,88 %
BANQUES	2,97 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	1,05 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,00 %
INDUSTRIES	6,40 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	2,78 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	2,56 %
ROUTE ET RAIL	0,48 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	0,20 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,16 %
SECTEUR MARITIME	0,10 %
MACHINES-OUTILS	0,09 %
COMPAGNIES AÉRIENNES	0,03 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,54 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,34 %
DISTRIBUTION MULTIPRODUITS	0,83 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	0,28 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,09 %
ÉNERGIE	2,21 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	2,21 %
IMMOBILIER	1,92 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	1,53 %
REIT COMMERCIAUX	0,24 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,14 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,74 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	1,01 %
LOGICIELS	0,60 %
SEMI-CONDUCTEURS	0,07 %
SERVICES INFORMATIQUES	0,06 %
MATÉRIAUX	1,33 %



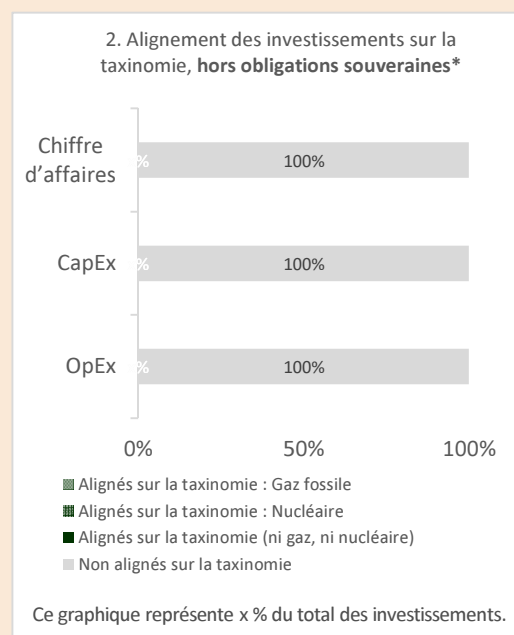
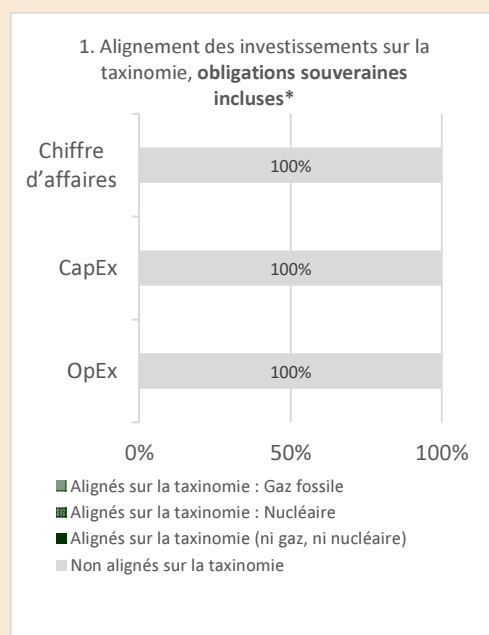
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- En gaz fossile En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.




* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,45 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Dans le cadre de la mise en œuvre de sa Politique d'investissement, le Compartiment sélectionne principalement ses titres parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres ont été exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment a éliminé les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit : State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300C9I4720D0IDK69

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : _____%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : _____%

Non

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il **promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La politique d'investissement du Compartiment State Street Global ESG Screened Defensive Equity Fund (le « Compartiment ») consiste à surperformer l'indice MSCI World Index (l'« Indice ») sur le long terme avec une volatilité moindre et une sensibilité limitée aux replis du marché. La politique d'investissement impliquera également d'exclure certains titres en fonction d'une évaluation de leur conformité avec les critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes du travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.



Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille tout au long de la période pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales et sociales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. Le Compartiment ne détenait aucun titre inclus dans les filtres négatifs et basés sur des normes.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment a examiné les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment a pris en considération

- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
REPUBLIC SERVICES INC	INDUSTRIES	1,56 %	ÉTATS-UNIS
ITOCHU CORP	INDUSTRIES	1,56 %	JAPON
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZEN	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,50 %	PAYS-BAS
WASTE MANAGEMENT INC	INDUSTRIES	1,48 %	ÉTATS-UNIS
ELI LILLY + CO	SOINS DE SANTÉ	1,46 %	ÉTATS-UNIS
MITSUBISHI CORP	INDUSTRIES	1,40 %	JAPON
LOBLAW COMPANIES LTD	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,38 %	CANADA
PEPSICO INC	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,38 %	ÉTATS-UNIS
MERCK + CO. INC.	SOINS DE SANTÉ	1,35 %	ÉTATS-UNIS
PROCTER + GAMBLE CO/THE	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	1,35 %	ÉTATS-UNIS
CANON INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,32 %	JAPON
SANOFI	SOINS DE SANTÉ	1,31 %	FRANCE
PACCAR INC	INDUSTRIES	1,30 %	ÉTATS-UNIS
CONSOLIDATED EDISON INC	SERVICES PUBLICS	1,30 %	ÉTATS-UNIS
TOKYO GAS CO LTD	SERVICES PUBLICS	1,30 %	JAPON

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

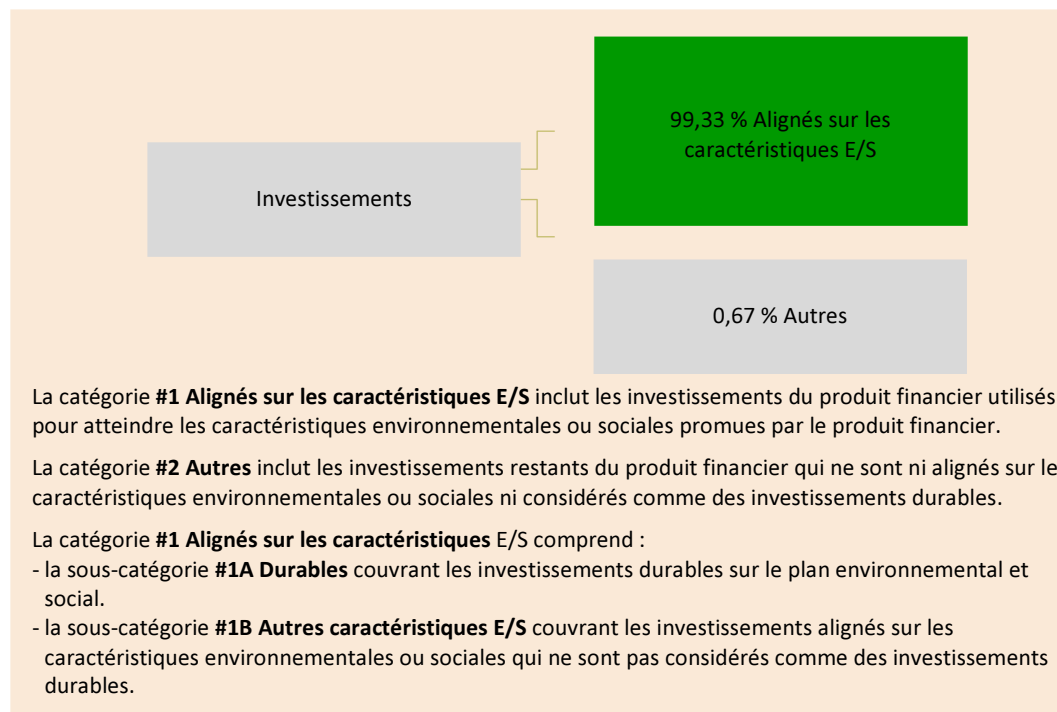
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Voir ci-dessous – Le Compartiment ne s'engage pas à réaliser des investissements durables au sens du SFDR ou du Règlement Taxinomie.



● Quelle était l'allocation des actifs ?

99,33 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 0,67 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

SOINS DE SANTÉ	22,61 %
EQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	9,32 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	9,21 %
BIOTECHNOLOGIE	4,08 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	18,41 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	6,94 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	6,88 %
PRODUITS DOMESTIQUES	2,27 %
BOISSONS	1,15 %
TABAC	1,15 %
PRODUITS DE SOINS PERSONNELS	0,02 %
INDUSTRIES	13,23 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	5,65 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	3,81 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,36 %
MACHINES-OUTILS	0,76 %
TRANSPORT AÉRIEN ET LOGISTIQUE	0,64 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,53 %


AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,48 %
SERVICES DE COMMUNICATION	9,68 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	6,35 %
MÉDIAS	1,25 %
DIVERTISSEMENTS	1,02 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,58 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	0,48 %
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	9,43 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	4,01 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	1,81 %
LOGICIELS	1,72 %
SERVICES INFORMATIQUES	0,77 %
SEMI-CONDUCTEURS	0,76 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,37 %
FINANCES	6,88 %
BANQUES	3,77 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	1,79 %
ASSURANCE	1,32 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	6,36 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	2,47 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,71 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	1,09 %
AUTOMOBILES	0,76 %
DISTRIBUTEURS	0,34 %
SERVICES PUBLICS	5,41 %
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	2,80 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	1,31 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	1,30 %
ÉNERGIE	3,36 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	3,36 %
MATÉRIAUX	2,20 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	1,72 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,38 %
PRODUITS CHIMIQUES	0,10 %
IMMOBILIER	1,68 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	1,58 %
REIT SPÉCIALISÉS	0,10 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

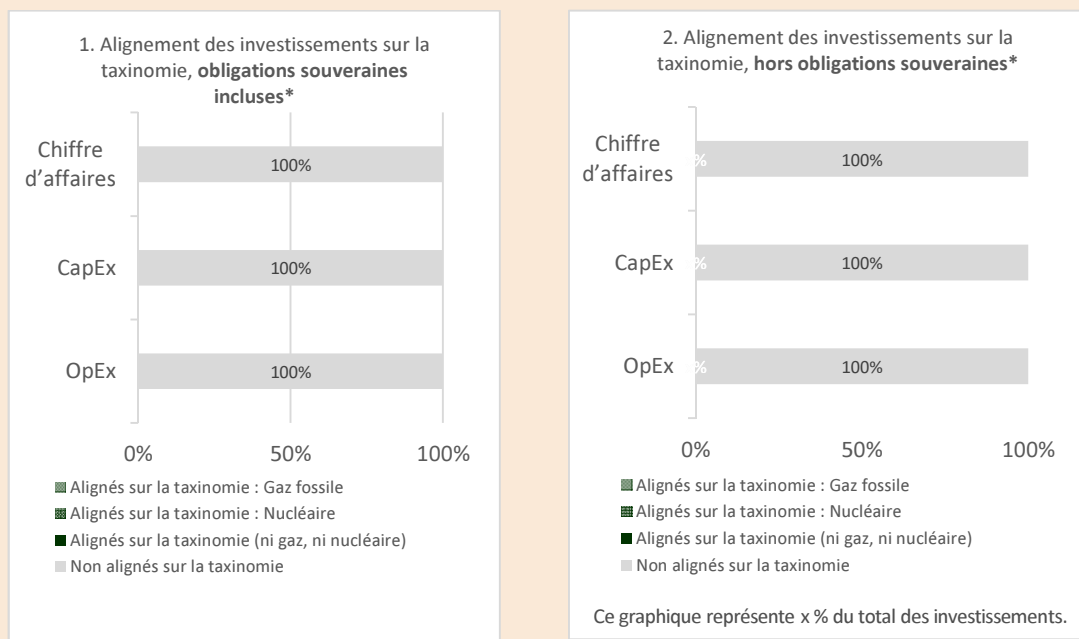
 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables** sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie.

● **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

- Oui :
- En gaz fossile
- En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et sociales, mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables sur le plan environnemental. Par conséquent, le Compartiment ne s'engage pas à réaliser une part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxinomie de l'UE.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

s/o



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 0,67 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment correspondent au filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille pour écarter les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Dans le cadre de la mise en œuvre de sa Politique d'investissement, le Compartiment sélectionne principalement ses titres parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue. En conséquence, les titres ont été exclus du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment a éliminé les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit : State Street Sustainable Climate US Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300F0UZT3QDKQWF24

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

●● <input type="checkbox"/> Oui	●● <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de 25 % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment promeut certaines caractéristiques environnementales au moyen de placements dans des sociétés qui affichent une empreinte carbone plus faible en termes d'émissions actuelles et futures (mesurées par les réserves de combustibles fossiles), qui génèrent des revenus verts et qui sont mieux positionnées pour faire face aux risques physiques posés par le changement climatique. En outre, d'autres caractéristiques environnementales et sociales sont promues au moyen d'un filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille du Compartiment pour éliminer les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à

savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées.

Le Compartiment promeut en outre certaines caractéristiques environnementales et sociales en allouant une portion de son portefeuille à des investissements durables. Pour que le titre soit admissible comme investissement durable, la société doit être définie comme « Société dominante » ou « Société surperformante » par le Gestionnaire financier à l'aide du score ESG généré dans le cadre d'un processus de notation interne.

● ***Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?***

La réalisation des caractéristiques environnementales est mesurée par l'exposition plus élevée du portefeuille du Compartiment (par rapport à l'indice MSCI USA Index (l'« Indice »)) aux sociétés qui atténuent les émissions de gaz à effet de serre et s'adaptent aux risques liés au climat.

La réduction de l'Intensité des émissions de carbone par rapport à celle de l'Indice est de 52 %

La réduction des Réserves de combustibles fossiles par rapport à celles de l'Indice est de 79 %

La réduction des revenus bruns par rapport à ceux de l'Indice est de 74 %

L'augmentation des revenus verts par rapport à ceux de l'Indice est de 179 %

Sociétés positionnées pour tirer parti de la transition vers une économie bas-carbone, sur la base d'une amélioration de 0,27 de leurs notations en matière d'adaptation au climat par rapport à l'Indice.

La réalisation effective des caractéristiques environnementales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. La réalisation des caractéristiques sociales est mesurée à travers un pourcentage nul du portefeuille investi en titres qui violent les Principes du PMNU et de sociétés impliquées dans le secteur des armes controversées.

● ***...et par rapport aux périodes précédentes ?***

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● ***Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?***

Les objectifs visés par les investissements durables du Compartiment consistent à investir dans des titres de sociétés classées comme : « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » d'après le score ESG généré par le système de notation ESG interne du Gestionnaire financier.

Le système de notation ESG mis au point par le Gestionnaire financier exploite de multiples sources de données et les aligne sur des cadres de matérialité transparents et largement reconnus, de manière à générer un score ESG unique pour les sociétés cotées. Il mesure la performance des opérations commerciales et de la gouvernance d'une société du fait qu'il reprend les défis ESG importants sur le plan financier relevés par le secteur d'activité de la société. Les sociétés qualifiées de « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » par le Gestionnaire financier à l'aide du score ESG généré dans le cadre d'un

processus de notation interne sont réputées être meilleures que leurs homologues du secteur dans la gestion et la limitation à long terme des risques en matière de durabilité importants sur le plan financier et donc, l'exploitation d'un modèle d'activité plus durable.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le Gestionnaire financier applique au Compartiment un filtre ESG négatif et basé sur des normes, afin d'exclure certaines sociétés sur la base d'une évaluation leur adhésion à des critères ESG donnés, en ce compris des sociétés identifiées comme contrevenant aux Principes du PMNU relatifs aux domaines suivants : protection environnementale, droits de l'homme, normes de travail, lutte contre la corruption et armes controversées. L'application du filtre ESG négatif et basé sur des normes en question permet au Gestionnaire financier de juger si les investissements durables du Compartiment causent un préjudice important à l'un quelconque des objectifs d'investissement durable environnementaux ou sociaux visés par ce dernier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment examine les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans le cadre de la Stratégie en actions Climat durable et en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment prend en considération

- les émissions de gaz à effet de serre
- l'empreinte carbone
- l'intensité des gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements
- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- la part de consommation et de production d'énergie non renouvelable

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
APPLE INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	8,08 %	ÉTATS-UNIS
MICROSOFT CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	6,47 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL C	SERVICES DE COMMUNICATION	3,57 %	ÉTATS-UNIS
AMAZON.COM INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	3,25 %	ÉTATS-UNIS
TESLA INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,58 %	ÉTATS-UNIS
NVIDIA CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,40 %	ÉTATS-UNIS
CSX CORP	INDUSTRIES	1,79 %	ÉTATS-UNIS
META PLATFORMS INC CLASS A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,67 %	ÉTATS-UNIS
CISCO SYSTEMS INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,61 %	ÉTATS-UNIS
VISA INC CLASS A SHARES	FINANCES	1,48 %	ÉTATS-UNIS
MASTERCARD INC A	FINANCES	1,39 %	ÉTATS-UNIS
JOHNSON + JOHNSON	SOINS DE SANTÉ	1,36 %	ÉTATS-UNIS
JPMORGAN CHASE + CO	FINANCES	1,29 %	ÉTATS-UNIS
GENERAL ELECTRIC CO	INDUSTRIES	1,16 %	ÉTATS-UNIS
UNITEDHEALTH GROUP INC	SOINS DE SANTÉ	1,08 %	ÉTATS-UNIS

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

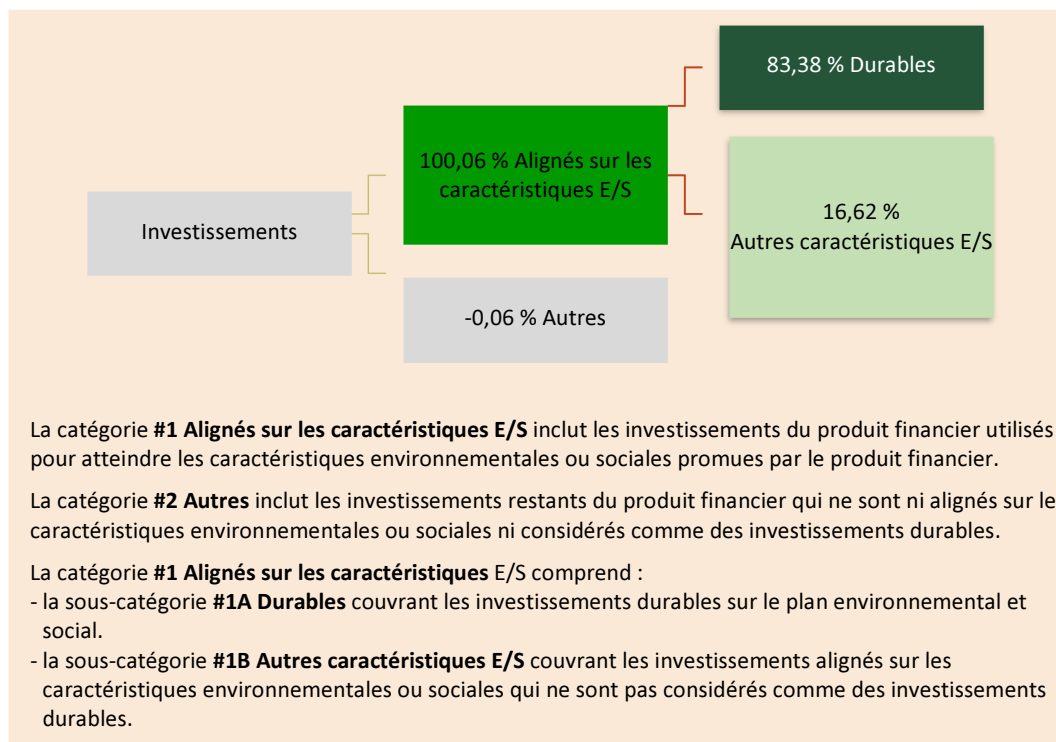
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

La part du Fonds investie en Investissements durables était de 83,38 % à la fin de l'exercice.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

100,06 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », 83,38 % étant des investissements durables comme indiqué dans le tableau ci-dessous. -0,06 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.





Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	29,26 %
LOGICIELS	10,46 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	8,84 %
SEMI-CONDUCTEURS	6,41 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	1,87 %
SERVICES INFORMATIQUES	1,54 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,13 %
SOINS DE SANTÉ	13,71 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	4,22 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	3,22 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,66 %
BIOTECHNOLOGIE	2,08 %
SCIENCES DE LA VIE	1,52 %
FINANCES	12,56 %
SERVICES FINANCIERS	3,31 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	3,07 %
BANQUES	2,79 %
ASSURANCE	2,60 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,47 %
SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	0,20 %
REIT HYPOTHÉCAIRES	0,11 %

BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	10,70 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	3,35 %
AUTOMOBILES	2,65 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,97 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	1,57 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	0,55 %
DISTRIBUTEURS	0,31 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,29 %
INDUSTRIES	10,12 %
ROUTE ET RAIL	2,75 %
MACHINES-OUTILS	1,66 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	1,16 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	1,00 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,91 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,86 %
SERVICES PROFESSIONNELS	0,62 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,62 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	0,30 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,26 %
SERVICES DE COMMUNICATION	9,18 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	5,63 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	1,28 %
DIVERTISSEMENTS	1,25 %
MÉDIAS	0,81 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,21 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	5,18 %
BOISSONS	1,34 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	1,21 %
PRODUITS DOMESTIQUES	1,11 %
TABAC	0,93 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,38 %
PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	0,11 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	0,11 %
IMMOBILIER	2,80 %
REIT RÉSIDENTIELS	0,75 %
REIT INDUSTRIELS	0,51 %
REIT DE BUREAUX	0,44 %
REIT SPÉCIALISÉS	0,37 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,34 %
REIT COMMERCIAUX	0,23 %
REIT – SANTÉ	0,10 %
REIT – HÔTELS ET COMPLEXES HÔTELIERS	0,06 %

ÉNERGIE	2,46 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	1,29 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	1,17 %
MATÉRIAUX	2,32 %
PRODUITS CHIMIQUES	1,18 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	0,61 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,53 %
SERVICES PUBLICS	1,68 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,95 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	0,73 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

● Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

En gaz fossile

En énergie nucléaire

X

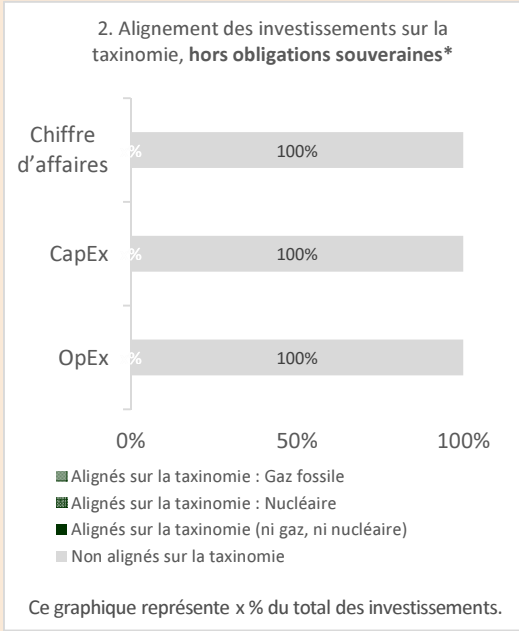
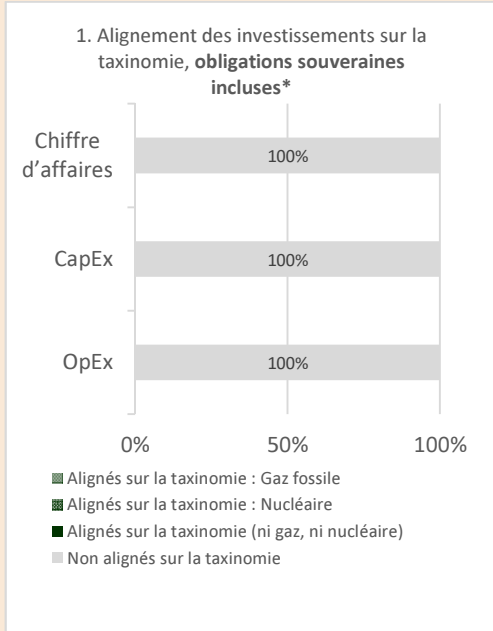
Non

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif environnemental, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.

représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif social, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait -0,06 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

La stratégie utilisée par le Compartiment est une méthodologie systématique qui offre une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux entreprises qui réduisent les risques liés au climat et s'adaptent.

Pour instaurer cette stratégie, le Gestionnaire financier a employé un processus quantitatif pour construire un portefeuille de titres en tenant compte de certains facteurs ESG tels que : l'intensité carbone (émissions proportionnelles au chiffre d'affaires), les réserves de combustibles fossiles, les revenus verts, les revenus bruns et les notations en matière d'adaptation au climat. Le portefeuille qui en résulte offre une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux entreprises qui réduisent et s'adaptent aux risques liés au climat. Les titres du Compartiment sont sélectionnés principalement parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue.

L'application des filtres ESG conduit à l'exclusion des titres du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment élimine les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Sustainable Climate World Equity Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300UN2KRY0QD46M87

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



Non



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____%



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%



Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de 25 % d'investissements durables.



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Le Compartiment promeut certaines caractéristiques environnementales au moyen de placements dans des sociétés qui affichent une empreinte carbone plus faible en termes d'émissions actuelles et futures (mesurées par les réserves de combustibles fossiles), qui génèrent des revenus verts et qui sont mieux positionnées pour faire face aux risques physiques posés par le changement climatique. En outre, d'autres caractéristiques environnementales et sociales sont promues au moyen d'un filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille du Compartiment pour

éliminer les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, à savoir les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption et les armes controversées. Le Compartiment peut utiliser des techniques d'examen ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure les titres sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs de ces critères ESG.

Le Compartiment promeut en outre certaines caractéristiques environnementales et sociales en allouant une portion de son portefeuille à des investissements durables. Pour que le titre soit admissible comme investissement durable, la société doit être définie comme « Société dominante » ou « Société surperformante » par le Gestionnaire financier à l'aide du score ESG généré dans le cadre d'un processus de notation interne.

● ***Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?***

La réalisation des caractéristiques environnementales est mesurée par l'exposition plus élevée du portefeuille du Compartiment (par rapport à l'indice MSCI World Index (l'« Indice »)) aux sociétés qui atténuent les émissions de gaz à effet de serre et s'adaptent aux risques liés au climat.

La réduction de l'Intensité des émissions de carbone par rapport à celle de l'Indice est de 60 %

La réduction des Réserves de combustibles fossiles par rapport à celles de l'Indice est de 90 %

La réduction des revenus bruns par rapport à ceux de l'Indice est de 90 %

L'augmentation des revenus verts par rapport à ceux de l'Indice est de 304 %

Sociétés positionnées pour tirer parti de la transition vers une économie bas-carbone, sur la base d'une amélioration de 0,25 de leurs notations en matière d'adaptation au climat par rapport à l'Indice.

La réalisation effective des caractéristiques environnementales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes. La réalisation des caractéristiques sociales est mesurée à travers un pourcentage nul du portefeuille investi en titres qui violent les Principes du PMNU et de sociétés impliquées dans le secteur des armes controversées.

● ***...et par rapport aux périodes précédentes ?***

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● ***Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?***

Les objectifs visés par les investissements durables du Compartiment consistent à investir dans des titres de sociétés classées comme : « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » d'après le score ESG généré par le système de notation ESG interne du Gestionnaire financier.

Le système de notation ESG mis au point par le Gestionnaire financier exploite de multiples sources de données et les aligne sur des cadres de matérialité transparents et largement reconnus, de manière à générer un score ESG unique pour les sociétés cotées. Il mesure la performance des opérations commerciales et de la gouvernance d'une société du fait qu'il reprend les défis ESG importants sur le plan financier relevés par le secteur d'activité de la société.

Les sociétés qualifiées de « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » par le Gestionnaire financier à l'aide du score ESG généré dans le cadre d'un processus de notation interne sont réputées être meilleures que leurs homologues du secteur dans la gestion et la limitation à long terme des risques en matière de durabilité importants sur le plan financier et donc, l'exploitation d'un modèle d'activité plus durable.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le Gestionnaire financier applique au Compartiment un filtre ESG négatif et basé sur des normes, afin d'exclure certaines sociétés sur la base d'une évaluation leur adhésion à des critères ESG donnés, en ce compris des sociétés identifiées comme contrevenant aux Principes du PMNU relatifs aux domaines suivants : protection environnementale, droits de l'homme, normes de travail, lutte contre la corruption et armes controversées. L'application du filtre ESG négatif et basé sur des normes en question permet au Gestionnaire financier de juger si les investissements durables du Compartiment causent un préjudice important à l'un quelconque des objectifs d'investissement durable environnementaux ou sociaux visés par ce dernier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le Compartiment examine les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans le cadre de la Stratégie en actions Climat durable et en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment prend en considération

- les émissions de gaz à effet de serre
- l'empreinte carbone
- l'intensité des gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements

Les principales incidences négatives

correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- la part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
APPLE INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	5,62 %	ÉTATS-UNIS
MICROSOFT CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	4,48 %	ÉTATS-UNIS
AMAZON.COM INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	2,19 %	ÉTATS-UNIS
CISCO SYSTEMS INC	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	2,00 %	ÉTATS-UNIS
TESLA INC	BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	1,93 %	ÉTATS-UNIS
SCHNEIDER ELECTRIC SE	INDUSTRIES	1,71 %	FRANCE
NVIDIA CORP	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,70 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL C	SERVICES DE COMMUNICATION	1,57 %	ÉTATS-UNIS
ALPHABET INC CL A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,21 %	ÉTATS-UNIS
ENBRIDGE INC	ÉNERGIE	1,12 %	CANADA
TOKYO ELECTRON LTD	TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	1,12 %	JAPON
META PLATFORMS INC CLASS A	SERVICES DE COMMUNICATION	1,08 %	ÉTATS-UNIS
VISA INC CLASS A SHARES	FINANCES	0,96 %	ÉTATS-UNIS
CANADIAN NATL RAILWAY CO	INDUSTRIES	0,92 %	CANADA
JPMORGAN CHASE + CO	FINANCES	0,91 %	ÉTATS-UNIS



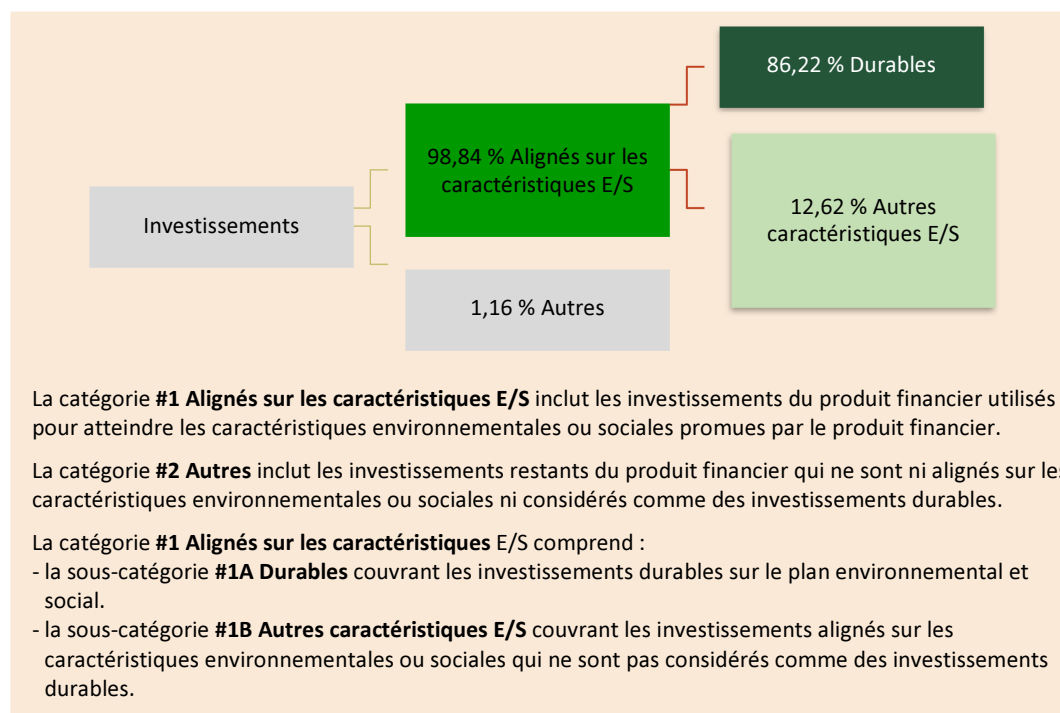
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

La part du Fonds investie en Investissements durables était de 86,22 % à la fin de l'exercice.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

● **Quelle était l'allocation des actifs ?**

98,84 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », 86,22 % étant des investissements durables comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,16 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION	23,22 %
LOGICIELS	7,49 %
ÉQUIP., STOCKAGE ET PÉRIPH.INFORMATIQUES	6,37 %
SEMI-CONDUCTEURS	5,54 %
ÉQUIPEMENT DE COMMUNICATION	2,20 %
SERVICES INFORMATIQUES	1,49 %
ÉQUIP. ET INSTRUMENTS ÉLECTRONIQUES	0,13 %
FINANCES	15,29 %
ASSURANCE	4,82 %
BANQUES	4,70 %
MARCHÉS DE CAPITAUX	2,78 %
SERVICES FINANCIERS	2,29 %
CRÉDIT À LA CONSOMMATION	0,54 %
REIT HYPOTHÉCAIRES	0,08 %

Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

SERVICES FINANCIERS DIVERSIFIÉS	0,07 %
SOINS DE SANTÉ	12,78 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	5,37 %
ÉQUIPEMENTS ET SERVICES DE SOINS DE SANTÉ	2,82 %
ÉQUIPEMENTS ET PROD. DE SOINS DE SANTÉ	2,15 %
BIOTECHNOLOGIE	1,40 %
SCIENCES DE LA VIE	1,03 %
TECHNOLOGIE DES SOINS DE SANTÉ	0,01 %
INDUSTRIES	11,83 %
ROUTE ET RAIL	2,94 %
ÉQUIPEMENT ÉLECTRIQUE	2,26 %
MACHINES-OUTILS	1,13 %
SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET DISTRIBUTEURS	0,99 %
CONGLOMÉRATS INDUSTRIELS	0,87 %
TRANSPORT TERRESTRE	0,75 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,74 %
PRODUITS DE CONSTRUCTION	0,72 %
SERVICES PROFESSIONNELS	0,70 %
CONSTRUCTION ET INGÉNIERIE	0,59 %
INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT	0,12 %
SERVICES ET FOURNITURES COMMERCIALES	0,02 %
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRES	10,48 %
AUTOMOBILES	2,55 %
DISTRIBUTION GÉNÉRALISTE	2,45 %
DISTRIB. DE PRODUITS DE CONSO. SPÉCIALISÉS	1,60 %
HÔTELS, RESTAURANTS ET LOISIRS	1,48 %
TEXTILES, HABILLEMENT ET PROD. DE LUXE	0,85 %
PIÈCES DÉTACHÉES AUTOMOBILES	0,67 %
BIENS DE CONSOMMATION DURABLES	0,60 %
DISTRIBUTEURS	0,25 %
SERVICES AU CONSOMMATEUR DIVERSIFIÉS	0,02 %
MÉDIAS	0,01 %
PRODUITS DE LOISIRS	0,00 %
SERVICES DE COMMUNICATION	7,88 %
MÉDIAS ET SERVICES INTERACTIFS	3,91 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS DIVERSIFIÉS	2,03 %
MÉDIAS	0,89 %
DIVERTISSEMENTS	0,74 %
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATIONS SANS FIL	0,30 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	6,34 %
COMMERCE DE DÉTAIL DE DENRÉES ALIMENTAIRES ET DE PRODUITS DE BASE	2,35 %
PRODUITS DOMESTIQUES	1,06 %

PRODUITS DE SOIN PERSONNEL	1,05 %
BOISSONS	0,82 %
TABAC	0,62 %
DISTRIBUTION DE BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,29 %
PRODUITS ALIMENTAIRES	0,16 %
ÉNERGIE	3,60 %
PÉTROLE, GAZ ET COMBUSTIBLES	3,16 %
ÉQUIPEMENT ET SERVICES ÉNERGÉTIQUES	0,44 %
MATÉRIAUX	3,20 %
PRODUITS CHIMIQUES	1,71 %
MÉTAUX ET EXPLOITATION MINIÈRE	1,15 %
EMBALLAGES ET CONTENEURS	0,31 %
PAPIER ET PRODUITS ET FORESTIERS	0,03 %
IMMOBILIER	2,63 %
GESTION ET PROMOTION IMMOBILIÈRE	0,80 %
REIT INDUSTRIELS	0,52 %
REIT RÉSIDENTIELS	0,50 %
REIT DE BUREAUX	0,37 %
REIT SPÉCIALISÉS	0,32 %
REIT DE CAPITAUX PROPRES	0,06 %
REIT COMMERCIAUX	0,04 %
REIT DIVERSIFIÉS	0,02 %
SERVICES PUBLICS	1,73 %
SERVICES PUBLICS - EAU	0,91 %
SERVICES PUBLICS - ÉLECTRICITÉ	0,47 %
SERVICES PUBLICS - GAZ	0,18 %
PRODUCTEURS INDÉPENDANTS D'ÉNERGIE ET D'ÉLECTRICITÉ RENOUVELABLE	0,17 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

- **Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?**

Oui :

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

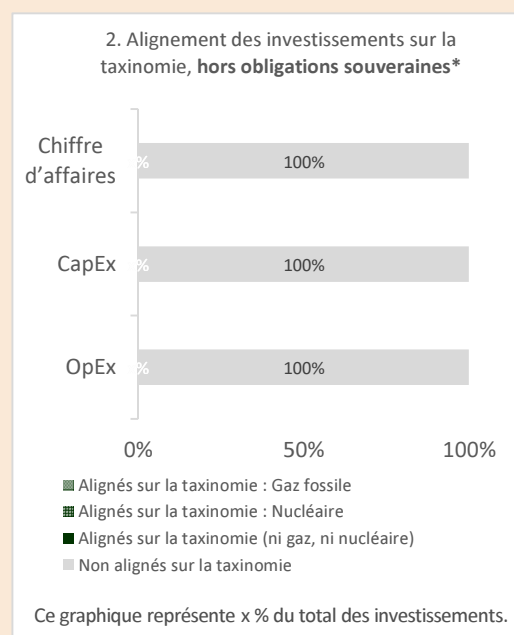
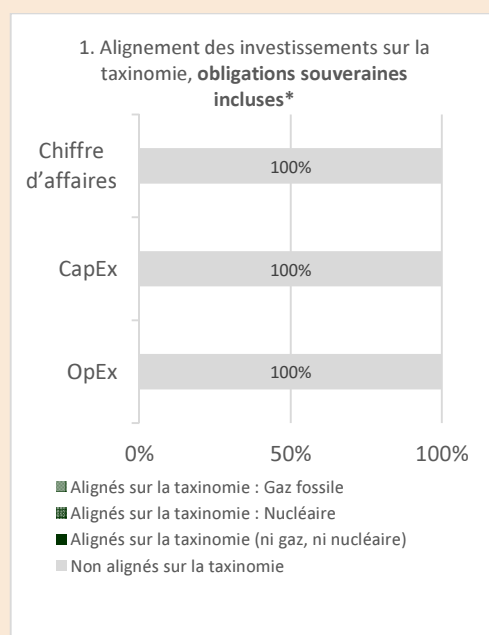
En gaz fossile En énergie nucléaire

X Non

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du Règlement Taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne tiennent pas compte des critères applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif environnemental, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif social, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,16 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

La stratégie utilisée par le Compartiment est une méthodologie systématique qui offre une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux entreprises qui réduisent les risques liés au climat et s'adaptent.

Pour instaurer cette stratégie, le Gestionnaire financier a employé un processus quantitatif pour construire un portefeuille de titres en tenant compte de certains facteurs ESG tels que : l'intensité carbone (émissions proportionnelles au chiffre d'affaires), les réserves de combustibles fossiles, les revenus verts, les revenus bruns et les notations en matière d'adaptation au climat. Le portefeuille qui en résulte offre une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux entreprises qui réduisent et s'adaptent aux risques liés au climat. Les titres du Compartiment sont sélectionnés principalement parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue.

L'application des filtres ESG conduit à l'exclusion des titres du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment élimine les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Sustainable Climate US Corporate Bond Fund

Identifiant d'entité juridique : 5493008SOKGTNM21F646

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Oui	<input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Non
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____% <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE 	<input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de 25 % d'investissements durables. <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE <input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif social
<input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%	<input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment promeut certaines caractéristiques environnementales en investissant dans des obligations de sociétés qui affichent une empreinte carbone plus faible en termes d'émissions actuelles et futures (mesurées par les réserves de combustibles fossiles), des obligations labellisées vertes et alignées sur le climat, ainsi que des obligations d'entreprise émises par des sociétés qui sont mieux positionnées face aux

Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

risques physiques posés par le changement climatique. En outre, d'autres caractéristiques environnementales et sociales sont promues au moyen d'un filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille du Compartiment pour éliminer les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption, les armes controversées et le tabac. Le Compartiment peut utiliser des techniques d'examen ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure des titres d'émetteurs sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs de ces critères ESG.

Le Compartiment promeut en outre certaines caractéristiques environnementales et sociales en allouant une portion de son portefeuille à des investissements durables. Pour que le titre soit admissible comme investissement durable, la société doit être définie comme « Société dominante » ou « Société surperformante » par le Gestionnaire financier à l'aide du score ESG généré dans le cadre d'un processus de notation interne.

● ***Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?***

La réalisation des caractéristiques environnementales est mesurée par l'exposition plus élevée du portefeuille du Compartiment (par rapport à l'indice Bloomberg US Corporate Bond Index (l'« Indice »)) aux sociétés qui atténuent les émissions de gaz à effet de serre et s'adaptent aux risques liés au climat.

La réduction de l'intensité des émissions de carbone par rapport à celle de l'Indice est de 185 %

La réduction des Réserves de combustibles fossiles par rapport à celles de l'Indice est de 89 %

La réduction des revenus bruts par rapport à ceux de l'Indice est de 4 %

L'exposition aux obligations vertes et alignées sur le climat a augmenté de 6 % par rapport à celle de l'Indice

Sociétés positionnées pour tirer parti de la transition vers une économie bas-carbone, sur la base d'un maintien de leurs notations en matière d'adaptation au climat par rapport à l'Indice.

La réalisation effective des caractéristiques environnementales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes.

La réalisation des caractéristiques sociales est mesurée à travers un pourcentage nul du portefeuille investi en titres qui violent les Principes du PMNU et de sociétés impliquées dans le secteur des armes controversées.

● ***...et par rapport aux périodes précédentes ?***

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● ***Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?***

Les objectifs visés par les investissements durables du Compartiment consistent à investir dans des titres de sociétés classées comme : « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » d'après le score ESG généré par le système de notation ESG interne du Gestionnaire financier et/ou alignées sur le processus de filtrage de la base de données d'obligations vertes de l'Initiative pour les obligations climatiques (*Climate Bonds Initiative*, « CBI »).

Le système de notation ESG mis au point par le Gestionnaire financier exploite de multiples sources de données et les aligne sur des cadres de matérialité transparents et largement reconnus, de manière à générer un score ESG unique pour les sociétés cotées. Il mesure la performance des opérations commerciales et de la gouvernance d'une société du fait qu'il reprend les défis ESG importants sur le plan financier relevés par le secteur d'activité de la société.

Les sociétés qualifiées de « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » par le Gestionnaire financier à l'aide du score ESG généré dans le cadre d'un processus de notation interne sont réputées être meilleures que leurs homologues du secteur dans la gestion et la limitation à long terme des risques en matière de durabilité importants sur le plan financier et donc, l'exploitation d'un modèle d'activité plus durable.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le Gestionnaire financier applique au Compartiment un filtre ESG négatif et basé sur des normes, afin d'exclure certaines sociétés sur la base d'une évaluation leur adhésion à des critères ESG donnés, en ce compris des sociétés identifiées comme contrevenant aux Principes du PMNU relatifs aux domaines suivants : protection environnementale, droits de l'homme, normes de travail, lutte contre la corruption, armes controversées et tabac. L'application du filtre ESG négatif et basé sur des normes en question permet au Gestionnaire financier de juger si les investissements durables du Compartiment causent un préjudice important à l'un quelconque des objectifs d'investissement durable environnementaux ou sociaux visés par ce dernier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment examine les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans le cadre de la Stratégie en actions Climat durable et en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment prend en considération

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- les émissions de gaz à effet de serre
- l’empreinte carbone
- l’intensité des gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements
- l’exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- la part de consommation et de production d’énergie non renouvelable
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l’exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d’investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

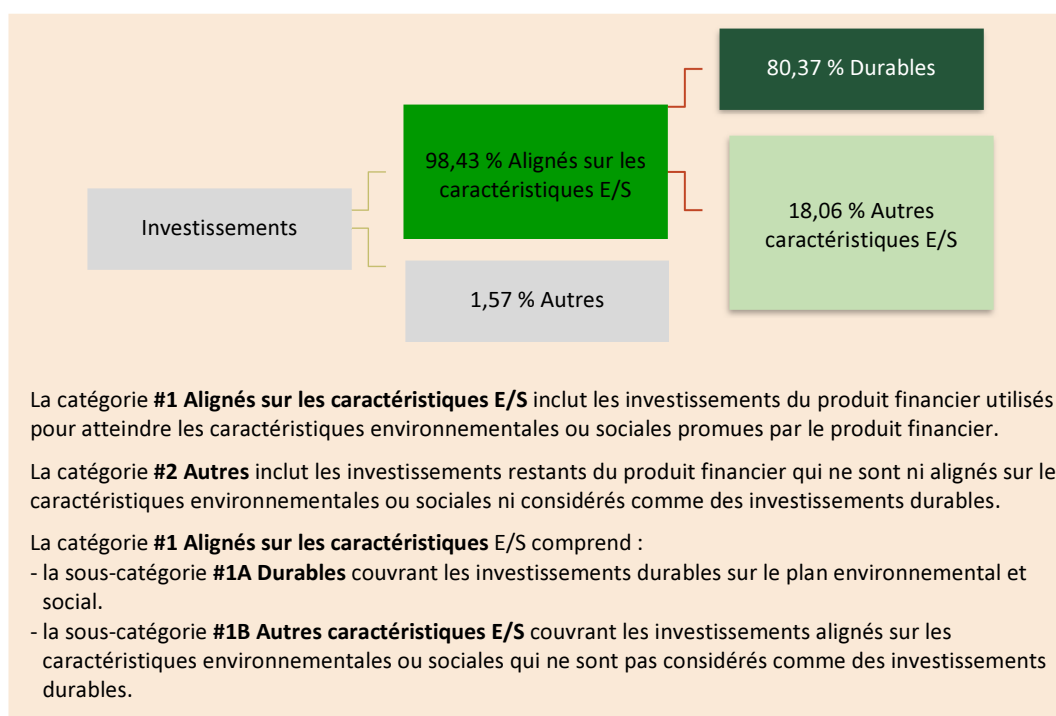
Investissements les plus importants	Secteur	% d’actifs	Pays
BANK OF AMERICA CORP	BANQUE	3,31 %	ÉTATS-UNIS
JPMORGAN CHASE + CO	BANQUE	2,97 %	ÉTATS-UNIS
MORGAN STANLEY	BANQUE	2,20 %	ÉTATS-UNIS
GOLDMAN SACHS GROUP INC	BANQUE	2,04 %	ÉTATS-UNIS
CITIGROUP INC	BANQUE	2,01 %	ÉTATS-UNIS
VERIZON COMMUNICATIONS	COMMUNICATION	1,62 %	ÉTATS-UNIS
HSBC HOLDINGS PLC	BANQUE	1,55 %	ROYAUME-UNI
APPLE INC	TECHNOLOGIE	1,53 %	ÉTATS-UNIS
ORACLE CORP	TECHNOLOGIE	1,52 %	ÉTATS-UNIS
AT+T INC	COMMUNICATION	1,46 %	ÉTATS-UNIS
COMCAST CORP	COMMUNICATION	1,41 %	ÉTATS-UNIS
UNION PACIFIC CORP	TRANSPORTS	1,27 %	ÉTATS-UNIS
AMAZON.COM INC	CONSOMMATION CYCLIQUE	1,08 %	ÉTATS-UNIS
MCDONALD S CORP	CONSOMMATION CYCLIQUE	1,06 %	ÉTATS-UNIS
AMGEN INC	CONSOMMATION NON CYCLIQUE	1,04 %	ÉTATS-UNIS

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

La part du Fonds investie en Investissements durables était de 80,37 % à la fin de l'exercice.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

98,43 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », 80,37 % étant des investissements durables comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,57 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

BANQUE	26,69 %
BANQUE	26,69 %
CONSOMMATION NON CYCLIQUE	16,21 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	6,57 %
SANTÉ	4,25 %
ALIMENTATION ET BOISSONS	3,95 %
PRODUITS DE CONSOMMATION	1,29 %
SUPERMARCHÉS	0,15 %
TECHNOLOGIE	12,64 %
TECHNOLOGIE	12,64 %

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

COMMUNICATION	10,67 %
LIGNES FILAIRES	3,82 %
LIGNES SANS FIL	2,47 %
MÉDIAS ET LOISIRS	2,37 %
CÂBLE ET SATELLITE	2,01 %
CONSOMMATION CYCLIQUE	8,20 %
COMMERCE DE DÉTAIL	3,92 %
AUTOMOBILE	2,38 %
RESTAURANTS	1,39 %
SERVICES DE CONSOMMATION CYCLIQUE	0,51 %
HÉBERGEMENT	0,00 %
ASSURANCE	4,67 %
ASSURANCE SANTÉ	1,88 %
DOMMAGES ET RESPONSABILITÉ CIVILE	1,82 %
ASSURANCE VIE	0,97 %
TRANSPORTS	4,35 %
CHEMINS DE FER	3,52 %
SERVICES DE TRANSPORT	0,82 %
BIENS D'ÉQUIPEMENT	3,89 %
INDUSTRIE MANUFACTURIÈRE DIVERSIFIÉE	1,83 %
MACHINES DE CONSTRUCTION	0,91 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,51 %
ENVIRONNEMENT	0,36 %
EMBALLAGES	0,23 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,05 %
REIT	3,32 %
REIT – BUREAUX	0,90 %
REIT – AUTRES	0,66 %
REIT – DÉTAIL	0,65 %
REIT - APPARTEMENTS	0,62 %
REIT – ÉTABLISSEMENTS DE SANTÉ	0,48 %
ÉLECTRICITÉ	2,76 %
ÉLECTRICITÉ	2,76 %
INDUSTRIE DE BASE	1,49 %
PRODUITS CHIMIQUES	1,00 %
MÉTAUX ET INDUSTRIE MINIÈRE	0,44 %
PAPIER	0,05 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	1,25 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	1,25 %
ÉNERGIE	1,22 %
SECTEUR INTERMÉDIAIRE	0,99 %
RAFFINERIES	0,23 %

SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	0,78 %
SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	0,78 %
GAZ NATUREL	0,73 %
GAZ NATUREL	0,73 %
SERVICES PUBLICS – AUTRES	0,50 %
SERVICES PUBLICS – AUTRES	0,50 %
INDUSTRIE – AUTRES	0,09 %
INDUSTRIE – AUTRES	0,09 %
FINANCE – AUTRES	0,04 %
FINANCE – AUTRES	0,04 %
FINANCE	0,01 %
FINANCE – AUTRES	0,01 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

Oui :

En gaz fossile

En énergie nucléaire

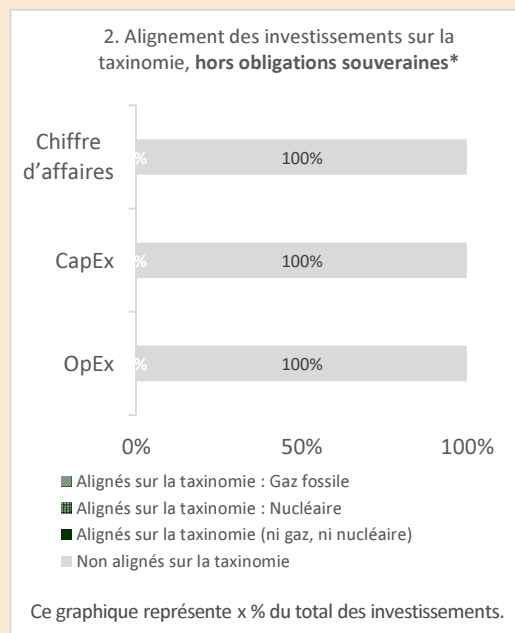
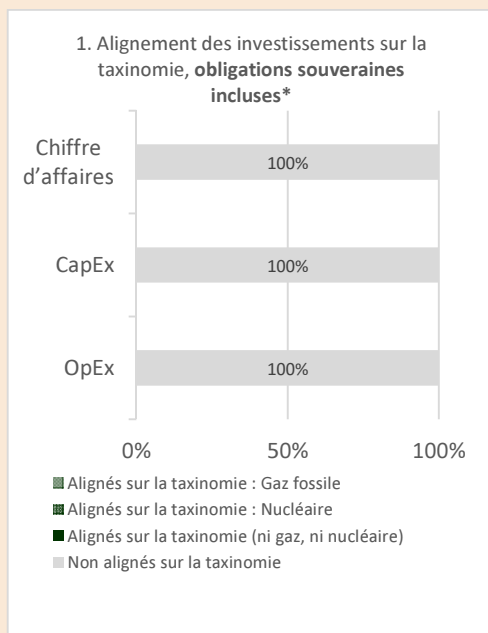
Non

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.


● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif environnemental, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif social, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,57 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

La stratégie utilisée par le Compartiment est une méthodologie systématique qui offre une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux entreprises qui réduisent les risques liés au climat et s'adaptent.

Pour instaurer cette stratégie, le Gestionnaire financier a employé un processus quantitatif pour construire un portefeuille de titres en tenant compte de certains facteurs ESG tels que : l'intensité carbone (émissions proportionnelles au chiffre d'affaires), les réserves de combustibles fossiles, les revenus verts, les revenus bruns et les notations en matière d'adaptation au climat. Le portefeuille qui en résulte offre une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux entreprises qui réduisent et s'adaptent aux risques liés au climat. Les titres du Compartiment sont sélectionnés principalement parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue.

L'application des filtres ESG conduit à l'exclusion des titres du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment éliminera les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promet.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : State Street Sustainable Climate Euro Corporate Bond Fund

Identifiant d'entité juridique : 549300XZOKME431V8W03

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Oui	<input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Non
<p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : _____%</p> <p><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input type="checkbox"/> Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : _____%</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques environnementales et sociales (E/S) et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il présentait une proportion de 25 % d'investissements durables.</p> <p><input type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> ayant un objectif social</p> <p><input type="checkbox"/> Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé pas d'investissements durables</p>

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** évaluent la mesure dans laquelle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment promeut certaines caractéristiques environnementales en investissant dans des obligations de sociétés qui affichent une empreinte carbone plus faible en termes d'émissions actuelles et futures (mesurées par les réserves de combustibles fossiles), des obligations labellisées vertes et alignées sur le climat, ainsi que des obligations d'entreprise émises par des sociétés qui sont mieux positionnées face aux risques physiques posés par le changement climatique.

En outre, d'autres caractéristiques environnementales et sociales sont promues au moyen d'un filtre négatif et basé sur des normes, appliqué au portefeuille du Compartiment pour éliminer les titres sur la base d'une évaluation de leur adhésion aux critères ESG, c.-à-d. les normes internationales concernant la protection environnementale, les droits de l'homme, les normes de travail, la lutte contre la corruption, les armes controversées et le tabac. Le Compartiment peut utiliser des techniques d'examen ESG supplémentaires, le cas échéant, afin d'exclure des titres d'émetteurs sur la base de leur implication dans une activité réputée contrevenir à l'un ou plusieurs de ces critères ESG.

Le Compartiment promeut en outre certaines caractéristiques environnementales et sociales en allouant une portion de son portefeuille à des investissements durables. Pour que le titre soit admissible comme investissement durable, la société doit être définie comme « Société dominante » ou « Société surperformante » par le Gestionnaire financier à l'aide du score ESG généré dans le cadre d'un processus de notation interne.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

La réalisation des caractéristiques environnementales est mesurée par l'exposition plus élevée du portefeuille du Compartiment (par rapport à l'indice Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (l'« Indice »)) aux sociétés qui atténuent les émissions de gaz à effet de serre et s'adaptent aux risques liés au climat.

La réduction de l'Intensité des émissions de carbone par rapport à celle de l'Indice est de 89 %

La réduction des Réserves de combustibles fossiles par rapport à celles de l'Indice est de 99 %

La réduction des revenus bruts par rapport à ceux de l'Indice est de 1 %

L'exposition aux obligations vertes et alignées sur le climat a augmenté de 18 % par rapport à celle de l'Indice

Sociétés positionnées pour tirer parti de la transition vers une économie bas-carbone, sur la base d'une baisse de 0,09 de leurs notations en matière d'adaptation au climat par rapport à l'Indice.

La réalisation effective des caractéristiques environnementales est mesurée à l'aide du pourcentage du portefeuille investi en titres qui sont inclus dans le filtre négatif et basé sur des normes.

La réalisation des caractéristiques sociales est mesurée à travers un pourcentage nul du portefeuille investi en titres qui violent les Principes du PMNU et de sociétés impliquées dans le secteur des armes controversées.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

La mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment n'a pas changé par rapport à la période précédente.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait partiellement réaliser et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Les objectifs visés par les investissements durables du Compartiment consistent à investir dans des titres de sociétés classées comme : « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » d'après le score ESG généré par le système de notation ESG interne du Gestionnaire financier et/ou alignées sur le processus de filtrage de la base de données d'obligations vertes de l'Initiative pour les obligations climatiques (*Climate Bonds Initiative*, « CBI »).

Le système de notation ESG mis au point par le Gestionnaire financier exploite de multiples sources de données et les aligne sur des cadres de matérialité transparents et largement reconnus, de manière à générer un score ESG unique pour les sociétés cotées. Il mesure la performance des opérations commerciales et de la gouvernance d'une société du fait qu'il reprend les défis ESG importants sur le plan financier relevés par le secteur d'activité de la société.

Les sociétés qualifiées de « Sociétés dominantes » ou « Sociétés surperformantes » par le Gestionnaire financier à l'aide du score ESG généré dans le cadre d'un processus de notation interne sont réputées être meilleures que leurs homologues du secteur dans la gestion et la limitation à long terme des risques en matière de durabilité importants sur le plan financier et donc, l'exploitation d'un modèle d'activité plus durable.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le Gestionnaire financier applique au Compartiment un filtre ESG négatif et basé sur des normes, afin d'exclure certaines sociétés sur la base d'une évaluation leur adhésion à des critères ESG donnés, en ce compris des sociétés identifiées comme contrevenant aux Principes du PMNU relatifs aux domaines suivants : protection environnementale, droits de l'homme, normes de travail, lutte contre la corruption, armes controversées et tabac. L'application du filtre ESG négatif et basé sur des normes en question permet au Gestionnaire financier de juger si les investissements durables du Compartiment causent un préjudice important à l'un quelconque des objectifs d'investissement durable environnementaux ou sociaux visés par ce dernier.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?



Le Compartiment examine les Principales incidences négatives (*Principal Adverse Impacts*, « PAI ») sur les facteurs de durabilité dans le cadre de la Stratégie en actions Climat durable et en appliquant le filtre ESG négatif et basé sur des normes avant de construire le portefeuille. Plus précisément, le Compartiment prend en considération

- les émissions de gaz à effet de serre
- l'empreinte carbone

- l'intensité des gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements
- l'exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles
- la part de consommation et de production d'énergie non renouvelable
- les violations des principes du Pacte mondial des Nations unies
- l'exposition aux armes controversées



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BNP PARIBAS	BANQUE	2,19 %	FRANCE
VOLKSWAGEN INTL FIN NV	CONSOMMATION CYCLIQUE	1,58 %	PAYS-BAS
ING GROEP NV	BANQUE	1,56 %	PAYS-BAS
SOCIETE GENERALE	BANQUE	1,29 %	FRANCE
CAIXABANK SA	BANQUE	1,27 %	ESPAGNE
BANCO SANTANDER SA	BANQUE	1,24 %	ESPAGNE
ABN AMRO BANK NV	BANQUE	1,19 %	PAYS-BAS
INTESA SANPAOLO SPA	BANQUE	1,16 %	ITALIE
DEUTSCHE BANK AG	BANQUE	1,12 %	ALLEMAGNE
E.ON SE	ÉLECTRICITÉ	1,10 %	ALLEMAGNE
ENGIE SA	GAZ NATUREL	1,03 %	FRANCE
CREDIT AGRICOLE SA	BANQUE	1,03 %	FRANCE
ORANGE SA	COMMUNICATION	0,96 %	FRANCE
MORGAN STANLEY	BANQUE	0,95 %	ÉTATS-UNIS
JPMORGAN CHASE + CO	BANQUE	0,90 %	ÉTATS-UNIS

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : du 1^{er} janvier 2023 au 31 décembre 2023

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

La part du Fonds investie en Investissements durables était de 94,58 % à la fin de l'exercice.

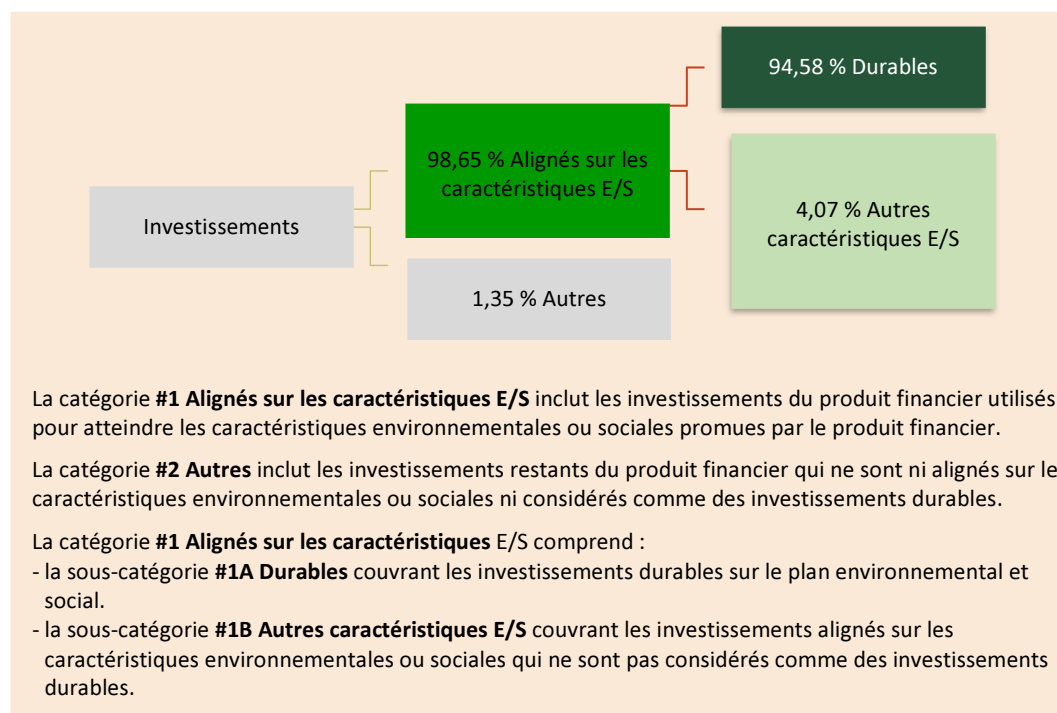
● Quelle était l'allocation des actifs ?

98,65 % des actifs du Compartiment ont été investis en titres classés sous la catégorie #1 « Alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales », 94,58 % étant des investissements durables comme indiqué dans le tableau ci-dessous. 1,35 % des actifs, composés de trésorerie ainsi que d'équivalents de trésorerie, ont été classés sous la



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessous et ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales promues.



Pour respecter la taxinomie de l'UE, les critères relatifs au **gaz fossile** comprennent des limitations sur les émissions et le passage à des énergies entièrement renouvelables ou à des carburants sobres en carbone d'ici à la fin de 2035. Pour **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles exhaustives de gestion de la sécurité et des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émissions de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

BANQUE	35,23 %
BANQUE	35,23 %
CONSOMMATION NON CYCLIQUE	11,96 %
ALIMENTATION ET BOISSONS	3,66 %
SANTÉ	3,57 %
PRODUITS PHARMACEUTIQUES	2,90 %
PRODUITS DE CONSOMMATION	1,21 %
SUPERMARCHÉS	0,61 %
CONSOMMATION CYCLIQUE	11,43 %
AUTOMOBILE	7,67 %
SERVICES DE CONSOMMATION CYCLIQUE	1,59 %
COMMERCE DE DÉTAIL	1,30 %
RESTAURANTS	0,87 %
COMMUNICATION	7,65 %
LIGNES FILAIRES	5,15 %
MÉDIAS ET LOISIRS	1,16 %
LIGNES SANS FIL	0,96 %
CÂBLE ET SATELLITE	0,38 %
ÉLECTRICITÉ	5,94 %
ÉLECTRICITÉ	5,94 %

ASSURANCE	4,48 %
ASSURANCE VIE	3,23 %
DOMMAGES ET RESPONSABILITÉ CIVILE	1,25 %
REIT	4,35 %
REIT – AUTRES	1,79 %
REIT – DÉTAIL	1,35 %
REIT – BUREAUX	1,13 %
REIT – ÉTABLISSEMENTS DE SANTÉ	0,08 %
BIENS D'ÉQUIPEMENT	4,03 %
INDUSTRIE MANUFACTURIÈRE DIVERSIFIÉE	2,96 %
MATÉRIAUX DE CONSTRUCTION	0,54 %
MACHINES DE CONSTRUCTION	0,39 %
EMBALLAGES	0,08 %
AÉRONAUTIQUE ET DÉFENSE	0,06 %
FINANCE – AUTRES	3,99 %
FINANCE – AUTRES	3,99 %
TECHNOLOGIE	3,95 %
TECHNOLOGIE	3,95 %
TRANSPORTS	2,11 %
SERVICES DE TRANSPORT	1,91 %
CHEMINS DE FER	0,20 %
GAZ NATUREL	1,53 %
GAZ NATUREL	1,53 %
INDUSTRIE DE BASE	1,08 %
PRODUITS CHIMIQUES	0,74 %
PAPIER	0,35 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	0,81 %
COURTIERS, GESTIONNAIRES D'ACTIFS ET BOURSES	0,81 %
INDUSTRIE – AUTRES	0,41 %
INDUSTRIE – AUTRES	0,41 %
ACTIFS NON GARANTIS	0,39 %
ACTIFS NON GARANTIS	0,39 %
ÉNERGIE	0,15 %
RAFFINERIES	0,07 %
INTÉGRÉE	0,07 %
SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	0,11 %
SOCIÉTÉS FINANCIÈRES	0,11 %
BONS DU TRÉSOR	0,03 %
BONS DU TRÉSOR	0,03 %
Finance	0,03 %
Immobilier	0,03 %
AUTORITÉS LOCALES	0,01 %



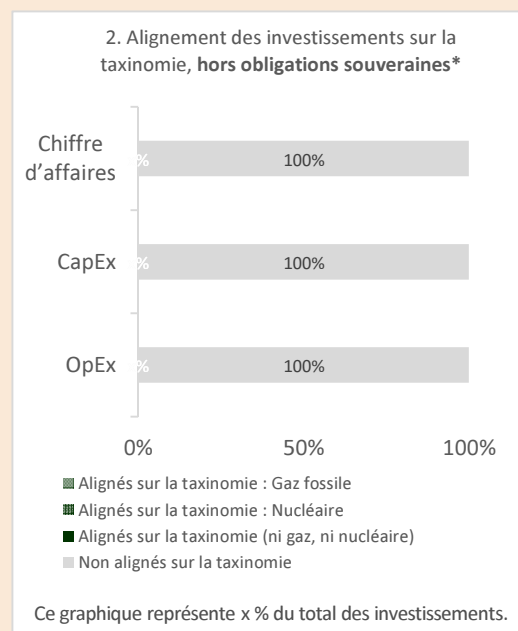
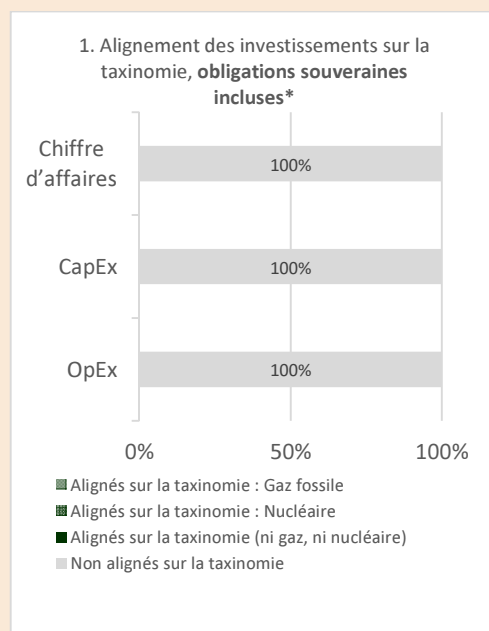
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment ne s'est pour l'heure pas engagé à réaliser des « investissements durables sur le plan environnemental » au sens du règlement Taxinomie.

Le produit financier a-t-il investi dans activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
 - En gaz fossile
 - En énergie nucléaire
- Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.*



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

¹ Les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire seront conformes à la taxinomie de l'UE uniquement si elles contribuent à l'atténuation du changement climatique et ne causent pas de préjudice important à l'un quelconque des objectifs de la taxinomie de l'UE ; voir la note explicative insérée dans la marge de gauche. L'ensemble des critères déterminant si les activités liées aux secteurs du gaz fossile et/ou de l'énergie nucléaire sont conformes à la taxinomie de l'UE sont énoncés dans le Règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

● **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Puisque le Compartiment ne s'engage pas à réaliser d'« investissement durable sur le plan environnemental » au sens du règlement taxinomie, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens dudit règlement est donc également fixée à 0 %.

● **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE n'a pas changé par rapport aux périodes de référence précédentes.



Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif environnemental, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.



Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?

Le Compartiment a l'intention d'allouer un minimum de 1 % de ses titres dans des investissements durables ayant un objectif social, qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE. L'évaluation permettant de qualifier les investissements du Compartiment de durables s'effectue lors du rééquilibrage, normalement trimestriel, du portefeuille, ou aux environs de cette date.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « Autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

En fin d'exercice, le Compartiment détenait 1,35 % de ses actifs sous forme de trésorerie ou d'équivalents de trésorerie, dont des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, à la discrétion du Gestionnaire financier, classés sous la catégorie #2 « Autres » dans le tableau ci-dessus. Étant donné la nature de la trésorerie ou des équivalents de trésorerie, ou des instruments financiers dérivés utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille, de couverture ou de gestion des liquidités, ces actifs ne seront pas alignés sur les caractéristiques environnementales et sociales, pas plus qu'il n'existera de garantie environnementale ou sociale en place.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?



représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

La stratégie utilisée par le Compartiment est une méthodologie systématique qui offre une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux entreprises qui réduisent les risques liés au climat et s'adaptent.

Pour instaurer cette stratégie, le Gestionnaire financier a employé un processus quantitatif pour construire un portefeuille de titres en tenant compte de certains facteurs ESG tels que : l'intensité carbone (émissions proportionnelles au chiffre d'affaires), les réserves de combustibles fossiles, les revenus verts, les revenus bruns et les notations en matière d'adaptation au climat. Le portefeuille qui en résulte offre une exposition supérieure (par rapport à celle de l'Indice) aux entreprises qui réduisent et s'adaptent aux risques liés au climat. Les titres du Compartiment sont sélectionnés principalement parmi les composantes de l'Indice et le Gestionnaire financier applique le filtre ESG négatif et basé sur des normes préalablement à la construction du portefeuille du Compartiment puis de manière continue.

L'application des filtres ESG conduit à l'exclusion des titres du portefeuille en fonction d'une évaluation de leur adhésion à certains critères ESG définis par le Gestionnaire financier. Le Compartiment éliminera les titres identifiés comme non conformes aux principes du Pacte mondial des Nations unies concernant la protection de l'environnement, les droits de l'homme, les normes de travail et la lutte contre la corruption, ainsi que les armes controversées.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Aucun indice spécifique n'a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.