

Rapport annuel
aux actionnaires
31 janvier 2024



MFS Meridian[®] Funds

MFS Meridian® Funds

SOMMAIRE

Lettre du Président	3
Tableau des performances	4
Notes relatives au tableau des performances	8
Informations générales	9
Gouvernance d'entreprise	9
Réclamations ou questions des actionnaires	9
Communication de certaines informations sur la gestion du risque	9
Règlement européen sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers	11
Tableaux des investissements	12
Bilans	194
Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net	199
Statistiques	204
Notes aux états financiers	240
Addenda	281
Rapport du Réviseur d'entreprises	288
Rapport du cabinet d'expertise comptable indépendant	290
Administrateurs et administration	292
Principaux agents locaux	Plat verso

Liste des Fonds MFS Meridian®

Les compartiments suivants constituent la famille des MFS Meridian Funds.

La dénomination de chaque compartiment est précédée de la mention « MFS Meridian Funds – », laquelle peut ne pas être reprise dans le reste du présent rapport.

Asia Ex-Japan Fund	Global Listed Infrastructure Fund
Blended Research® European Equity Fund	Global New Discovery Fund
Continental European Equity Fund	Global Opportunistic Bond Fund
Contrarian Value Fund	Global Research Focused Fund
Diversified Income Fund	Global Strategic Equity Fund
Emerging Markets Debt Fund	Global Total Return Fund
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Inflation-Adjusted Bond Fund
Emerging Markets Equity Fund	Japan Equity Fund
Emerging Markets Equity Research Fund	Limited Maturity Fund
Euro Credit Fund	Managed Wealth Fund
European Core Equity Fund	Prudent Capital Fund
European Research Fund	Prudent Wealth Fund
European Smaller Companies Fund	U.K. Equity Fund
European Value Fund	U.S. Concentrated Growth Fund
Global Concentrated Fund	U.S. Corporate Bond Fund
Global Credit Fund	U.S. Government Bond Fund
Global Equity Fund	U.S. Growth Fund
Global Equity Income Fund	U.S. Total Return Bond Fund
Global High Yield Fund	U.S. Value Fund
Global Intrinsic Value Fund	

En cas de contradiction entre la version anglaise et les traductions, la version anglaise fait foi.

Aucune souscription ne peut être acceptée sur le fondement des rapports financiers. Les souscriptions ne sont acceptées que sur le fondement du prospectus en vigueur accompagné du dernier rapport annuel et du dernier rapport semestriel, le cas échéant.

LETTRE DU PRÉSIDENT



Chères et Chers actionnaires,

Les banques centrales du monde entier ont considérablement durci leur politique monétaire jusqu'au troisième trimestre 2023 avant de faire une pause. Le rythme de resserrement de la Réserve fédérale américaine a presque été le plus rapide jamais vu, et la Banque centrale européenne a relevé ses taux au plus haut niveau depuis près de 25 ans. En outre, les décideurs politiques ont réduit la taille des bilans de leurs institutions, ce qui a eu pour effet de restreindre davantage les conditions financières. Ces actions ont fortement contribué à la baisse de l'inflation, bien qu'elle reste supérieure à l'objectif de 2 % des décideurs politiques.

Malgré des conditions financières plus difficiles, la croissance économique a mieux résisté que ce que prévoyaient de nombreux observateurs, notamment aux États-Unis, dans un contexte de demande soutenue de la part des consommateurs, de taux de chômage toujours faibles, de soutien économique constant grâce aux dépenses publiques en matière d'infrastructures, entre autres, et d'entreprises rapatriant une partie de leur production pour rendre leurs chaînes d'approvisionnement plus résilientes. La croissance en Europe a stagné fin 2023, mais elle a montré de modestes signes d'amélioration début 2024. L'Europe continue de s'adapter à la hausse des coûts énergétiques après avoir reconfiguré les chaînes d'approvisionnement en énergie pour exclure la Russie. La croissance en Chine reste décevante : le secteur immobilier du pays, en proie à des difficultés, continue de peser sur l'économie, tandis que la faiblesse de la confiance des investisseurs persiste.

La performance du marché des actions a été robuste, bien que la plupart des gains des principaux indices aient été liés à des sociétés exposées à l'intelligence artificielle. L'utilisation de grands modèles linguistiques a accéléré le rythme de l'adoption de l'IA par les entreprises et les ménages et a stimulé la demande en semi-conducteurs spécialisés. Les fabricants de médicaments anti-obésité ont également été les plus performants. Dans un contexte de marchés du travail relativement tendus, de conditions financières mondiales plus strictes et de volatilité des prix des matériaux, les investisseurs semblent plus préoccupés par le fait que les marges de bénéfice des entreprises en dehors du secteur technologique pourraient avoir dépassé leur maximum pour ce cycle. Cependant, les faibles niveaux de chômage sur les marchés développés et l'espoir que l'inflation ait passé son pic ont été des facteurs favorables au contexte macroéconomique.

En raison de la guerre en cours en Ukraine et de l'attaque du Hamas contre Israël, les investisseurs ont dû faire face à un environnement géopolitique instable qui a parfois augmenté la volatilité du marché.

Pendant les périodes de transition des marchés, il est important de bien connaître les fondamentaux de la société, et nous avons construit notre plate-forme de recherche mondiale unique pour y parvenir.

Chez MFS®, nous gérons les actifs de nos clients de manière responsable en naviguant soigneusement sur des marchés financiers mondiaux de plus en plus complexes. Notre équipe d'investissement s'appuie sur un engagement en faveur de l'investissement fondamental à long terme. Notre plate-forme d'investissement mondiale, combinant l'expertise collective, une discipline à long terme et une gestion réfléchie des risques, vise à identifier les idées d'investissement que nous estimons meilleures et plus durables sur les marchés du monde entier, ce qui nous permet de créer potentiellement de la valeur pour les investisseurs.

Cordialement,

Mitchell Freestone
Président du Conseil d'administration
MFS Investment Management Company (Lux) S.à r.l.
17 mai 2024

Les opinions exprimées dans la présente lettre sont sujettes à modification et ne constituent pas des conseils en investissement. Aucune prévision ne peut être garantie.

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

Catégorie d'actions	Asia Ex-Japan Fund	Blended Research European Equity Fund	Continental European Equity Fund	Contrarian Value Fund	Diversified Income Fund	Emerging Markets Debt Fund	Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Emerging Markets Equity Fund
A1 (EUR)	(14,05) %	7,35 %	7,81 %	12,15 %	S/O	5,12 %	6,69 %	(3,68) %
A1 (USD)	(14,53) %	6,69 %	7,20 %	11,51 %	3,04 %	4,49 %	6,04 %	(4,19) %
A2 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	3,05 %	4,47 %	6,02 %	S/O
A4 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	3,61 %	S/O	S/O	S/O
AH1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	8,89 %	0,93 %	2,29 %	S/O	S/O
AH1 (USD)	S/O	9,48 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
C1 (USD)	(15,18) %	5,94 %	6,39 %	10,65 %	1,91 %	3,47 %	4,92 %	(4,92) %
C2 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	2,04 %	3,44 %	5,04 %	S/O
I1 (EUR)	S/O	8,42 %	9,01 %	13,39 %	S/O	S/O	S/O	(2,63) %
I1 (GBP)	(15,96) %	4,86 %	5,43 %	9,66 %	S/O	2,44 %	S/O	(5,84) %
I1 (USD)	(13,60) %	7,79 %	8,39 %	12,73 %	3,86 %	5,31 %	6,75 %	(3,20) %
I2 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	(2,63) %
I2 (GBP)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	2,44 %	S/O	S/O
IF1 (EUR)	S/O	5,99 % (a)	4,31 % (a)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
IF1 (GBP)	S/O	S/O	0,54 % (a)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
IH1 (CHF)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	1,26 %	S/O	S/O
IH1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	9,89 %	1,99 %	3,23 %	S/O	S/O
IH1 (USD)	S/O	10,36 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
IH2 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	3,21 %	S/O	S/O
IS1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	6,51 % (a)	S/O	S/O	S/O	S/O
IS1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	5,47 %	S/O	S/O
ISH1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	3,38 %	S/O	S/O
ISH2 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	3,44 %	S/O	S/O
ISH2 (GBP)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	5,04 %	S/O	S/O
ISM1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	5,61 %	S/O	S/O
N1 (USD)	(15,00) %	6,20 %	6,69 %	10,94 %	2,50 %	3,97 %	5,48 %	(4,70) %
N2 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	2,42 %	3,94 %	5,53 %	S/O
NH1 (USD)	S/O	8,45 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
P1 (EUR)	S/O	7,31 %	S/O	10,54 % (a)	3,54 %	5,07 %	S/O	(3,62) %
P1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	2,96 %	4,49 %	S/O	(4,19) %
PH1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	0,93 %	2,47 %	S/O	(6,41) %
S1 (USD)	(13,69) %	S/O	S/O	S/O	S/O	5,06 %	S/O	(3,28) %
W1 (EUR)	S/O	8,35 %	8,91 %	13,33 %	4,42 %	6,84 %	S/O	S/O
W1 (GBP)	S/O	S/O	S/O	9,58 %	S/O	S/O	S/O	S/O
W1 (USD)	(13,71) %	7,70 %	8,26 %	12,65 %	3,80 %	5,15 %	6,69 %	(3,32) %
W2 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	3,79 %	5,09 %	6,66 %	S/O
WH1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	9,79 %	1,83 %	3,34 %	4,55 %	(5,42) %
WH1 (GBP)	S/O	9,91 %	10,24 %	11,45 %	3,31 %	4,61 %	5,98 %	(3,91) %
WH1 (USD)	S/O	10,27 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
WS1 (USD)	S/O	S/O	S/O	12,81 %	S/O	5,60 %	S/O	S/O
WSH1 (CHF)	S/O	S/O	S/O	7,54 %	S/O	S/O	S/O	S/O
WSH1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	9,98 %	S/O	8,52 %	S/O	S/O
WSH2 (GBP)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	5,25 %	S/O	S/O
Z1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	(1,75) %
Z1 (JPY)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	10,44 %
Z1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	6,05 %	S/O	S/O

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

Catégorie d'actions	Emerging Markets Equity Research Fund	Euro Credit Fund	European Core Equity Fund	European Research Fund	European Smaller Companies Fund	European Value Fund	Global Concentrated Fund	Global Credit Fund
A1 (EUR)	S/O	7,56 %	5,12 %	4,96 %	4,92 %	2,68 %	6,31 %	6,40 %
A1 (USD)	(5,49) %	6,87 %	4,53 %	4,32 %	4,27 %	2,10 %	5,67 %	5,76 %
A2 (USD)	S/O	6,80 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	5,81 %
AH1 (CHF)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	0,39 %	S/O	S/O
AH1 (EUR)	(7,48) %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	3,59 %
AH1 (USD)	S/O	S/O	6,94 %	6,79 %	6,70 %	4,75 %	S/O	S/O
C1 (USD)	(6,15) %	5,79 %	3,72 %	3,56 %	3,49 %	S/O	4,89 %	4,60 %
C2 (USD)	S/O	5,78 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	4,63 %
I1 (EUR)	(3,88) %	8,23 %	6,34 %	6,09 %	5,95 %	3,71 %	7,35 %	S/O
I1 (GBP)	(7,04) %	4,68 %	2,85 %	2,61 %	S/O	0,30 %	3,82 %	3,58 %
I1 (USD)	(4,45) %	7,60 %	5,74 %	5,48 %	5,35 %	3,12 %	6,73 %	6,47 %
IF1 (EUR)	S/O	8,56 % (a)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
IF1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	6,81 % (a)
IH1 (EUR)	(6,35) %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
IH1 (SGD)	S/O	S/O	S/O	11,78 %	S/O	S/O	S/O	S/O
IH1 (USD)	S/O	S/O	S/O	8,00 %	8,00 %	5,61 %	S/O	S/O
IH1R (EUR)	S/O	S/O	S/O	17,68 %	S/O	S/O	S/O	S/O
IS1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	6,25 %	6,17 %	3,90 %	S/O	S/O
ISB1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	6,50 %	S/O	S/O	S/O	S/O
ISD1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	5,94 % (a)	S/O	S/O	S/O	S/O
N1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	2,18 %	S/O	S/O
N1 (USD)	(5,91) %	6,34 %	3,98 %	3,83 %	3,73 %	1,61 %	5,12 %	5,22 %
N2 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	5,16 %
NH1 (USD)	S/O	S/O	6,62 %	6,36 %	6,34 %	S/O	S/O	S/O
P1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	4,94 %	S/O	S/O	6,31 %	S/O
P1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	5,68 %	S/O
PH1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	3,30 %	S/O
S1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	6,79 %	S/O
W1 (EUR)	S/O	8,09 %	6,25 %	5,99 %	5,70 %	3,48 %	7,11 %	S/O
W1 (GBP)	S/O	4,51 %	2,77 %	S/O	S/O	0,05 %	3,56 %	S/O
W1 (USD)	(4,57) %	7,45 %	5,67 %	5,39 %	5,09 %	2,85 %	6,40 %	6,35 %
W2 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	6,31 %
WH1 (EUR)	(6,37) %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	4,06 %	4,36 %
WH1 (GBP)	(5,03) %	S/O	7,59 %	7,47 %	S/O	4,71 %	5,55 %	5,80 %
WH1 (USD)	S/O	S/O	8,16 %	7,93 %	7,58 %	5,51 %	S/O	S/O
Z1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	6,89 %	S/O	4,59 %	S/O	S/O

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

Catégorie d'actions	Global Equity Fund	Global Equity Income Fund	Global High Yield Fund	Global Intrinsic Value Fund	Global Listed Infrastructure Fund(c)	Global New Discovery Fund	Global Opportunistic Bond Fund	Global Research Focused Fund
A1 (EUR)	5,87 %	S/O	9,62 %	11,58 %	3,20 %	6,54 %	4,67 %	11,16 %
A1 (USD)	5,28 %	2,74 %	9,04 %	10,96 %	3,90 %	5,97 %	4,11 %	10,54 %
A2 (USD)	S/O	2,75 %	8,95 %	S/O	S/O	S/O	4,03 %	S/O
AH1 (EUR)	3,05 %	0,78 %	S/O	8,64 %	3,10 %	3,53 %	2,04 %	S/O
C1 (USD)	4,49 %	1,99 %	7,95 %	10,04 %	3,60 %	5,19 %	3,09 %	9,70 %
C2 (USD)	S/O	1,96 %	7,80 %	S/O	S/O	S/O	3,11 %	S/O
I1 (EUR)	6,94 %	4,40 %	S/O	12,81 %	3,60 %	7,62 %	S/O	12,39 %
I1 (GBP)	3,42 %	S/O	S/O	9,09 %	2,87 %	4,08 %	S/O	8,70 %
I1 (JPY)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	26,33 %
I1 (USD)	6,31 %	3,80 %	9,90 %	12,14 %	4,37 %	7,00 %	4,76 %	11,74 %
IF1 (USD)	S/O	4,53 % (a)	S/O	S/O	4,47 %	7,40 % (a)	S/O	S/O
IH1 (CHF)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	4,04 % (a)	S/O
IH1 (EUR)	3,94 %	1,98 %	S/O	9,88 %	3,51 %	4,68 %	2,76 %	S/O
IH1 (GBP)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	4,13 %	S/O
IH1 (JPY)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	(0,32) %	5,72 %
IH2 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	2,73 %	S/O
IH2 (GBP)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	4,04 %	S/O
IS1 (EUR)	7,10 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
IS1 (USD)	S/O	S/O	7,01 % (a)	S/O	S/O	S/O	6,25 % (a)	S/O
IS2 (USD)	S/O	S/O	7,75 % (a)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
ISH1 (EUR)	S/O	S/O	6,11 % (a)	S/O	S/O	S/O	4,45 % (a)	S/O
ISH2 (GBP)	S/O	S/O	6,77 % (a)	S/O	S/O	S/O	5,71 % (a)	S/O
N1 (USD)	4,77 %	2,28 %	8,44 %	10,38 %	3,70 %	5,37 %	3,47 %	9,97 %
N2 (USD)	S/O	2,21 %	8,46 %	S/O	S/O	S/O	3,61 %	S/O
P1 (EUR)	5,90 %	S/O	S/O	11,58 %	S/O	6,03 % (a)	4,67 %	S/O
P1 (USD)	5,27 %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	4,11 %	S/O
PH1 (EUR)	3,01 %	S/O	S/O	8,68 %	S/O	S/O	2,25 %	S/O
S1 (USD)	6,23 %	S/O	9,51 %	S/O	S/O	S/O	S/O	11,46 %
W1 (EUR)	6,68 %	S/O	S/O	12,70 %	S/O	S/O	5,25 %	S/O
W1 (GBP)	3,12 %	S/O	S/O	9,01 %	S/O	4,01 %	S/O	S/O
W1 (USD)	6,07 %	3,70 %	9,81 %	12,05 %	4,30 %	6,92 %	4,59 %	11,63 %
W2 (USD)	S/O	3,70 %	9,76 %	S/O	S/O	S/O	4,68 %	S/O
WH1 (EUR)	3,86 %	1,91 %	7,88 %	9,77 %	3,50 %	4,36 %	2,68 %	S/O
WH1 (GBP)	5,20 %	3,23 %	9,34 %	11,36 %	4,00 %	5,93 %	4,14 %	S/O
WS1 (USD)	S/O	S/O	7,70 % (a)	S/O	S/O	S/O	6,20 % (a)	S/O
WS2 (USD)	S/O	S/O	7,74 % (a)	S/O	S/O	S/O	6,01 % (a)	S/O
WSH1 (EUR)	S/O	S/O	6,96 % (a)	S/O	S/O	S/O	4,39 % (a)	S/O
WSH2 (EUR)	S/O	S/O	6,98 % (a)	S/O	S/O	S/O	5,25 % (a)	S/O
WSH2 (GBP)	S/O	S/O	7,55 % (a)	S/O	S/O	S/O	5,55 % (a)	S/O
Z1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	5,23 %	S/O

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

Catégorie d'actions	Global Strategic Equity Fund	Global Total Return Fund	Inflation-Adjusted Bond Fund	Japan Equity Fund	Limited Maturity Fund	Managed Wealth Fund	Prudent Capital Fund	Prudent Wealth Fund
A1 (EUR)	24,33 %	3,44 %	S/O	10,43 %	4,79 %	S/O	9,36 %	9,27 %
A1 (USD)	23,66 %	2,89 %	0,26 %	9,84 %	4,27 %	4,88 %	8,76 %	8,62 %
A2 (USD)	S/O	2,88 %	0,36 %	S/O	4,22 %	S/O	S/O	S/O
A4 (EUR)	S/O	3,45 %	S/O	S/O	S/O	S/O	9,40 %	S/O
AH1 (CHF)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	4,24 %	S/O
AH1 (EUR)	21,13 %	0,71 %	S/O	S/O	S/O	2,98 %	6,37 %	6,63 %
C1 (USD)	22,74 %	1,99 %	(0,86) %	8,99 %	3,15 %	4,06 %	7,92 %	7,84 %
C2 (USD)	S/O	2,00 %	(0,85) %	S/O	3,10 %	S/O	S/O	S/O
I1 (EUR)	25,74 %	S/O	S/O	11,72 %	S/O	6,49 %	10,59 %	10,37 %
I1 (GBP)	21,60 %	1,00 %	S/O	8,04 %	S/O	3,00 %	6,94 %	6,73 %
I1 (JPY)	S/O	S/O	S/O	25,57 %	S/O	S/O	S/O	S/O
I1 (USD)	25,02 %	3,90 %	0,77 %	11,07 %	4,92 %	5,88 %	9,94 %	9,72 %
IF1 (USD)	19,68 % (a)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
IH1 (EUR)	22,36 %	1,72 %	(1,26) %	S/O	3,14 % (a)	3,92 %	7,74 %	7,40 %
IH1R (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	18,91 %	S/O
N1 (USD)	23,08 %	2,28 %	(0,31) %	9,32 %	3,71 %	4,31 %	8,22 %	8,12 %
N2 (USD)	S/O	2,22 %	(0,32) %	S/O	3,64 %	S/O	S/O	S/O
P1 (EUR)	S/O	3,44 %	S/O	S/O	S/O	5,43 %	9,36 %	S/O
P1 (USD)	S/O	2,88 %	S/O	S/O	S/O	4,88 %	8,76 %	S/O
PH1 (EUR)	S/O	0,54 %	S/O	S/O	S/O	3,11 %	6,67 %	S/O
S1 (USD)	S/O	3,76 %	0,62 %	S/O	4,72 %	S/O	9,74 %	S/O
W1 (EUR)	S/O	4,05 %	S/O	S/O	S/O	S/O	10,48 %	10,12 %
W1 (GBP)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	6,93 %	6,46 %
W1 (USD)	24,93 %	3,54 %	0,68 %	10,95 %	4,89 %	5,77 %	9,80 %	9,44 %
W2 (USD)	S/O	3,54 %	0,63 %	S/O	4,88 %	S/O	S/O	S/O
WH1 (EUR)	22,22 %	1,23 %	S/O	S/O	S/O	3,76 %	7,48 %	7,38 %
WH1 (GBP)	24,07 %	2,31 %	S/O	S/O	S/O	5,26 %	9,12 %	8,82 %
ZH1 (JPY)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	4,62 %	S/O

TABLEAU DES PERFORMANCES (non révisé)

Taux de rendement totaux pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

Catégorie d'actions	U.K. Equity Fund	U.S. Concentrated Growth Fund	U.S. Corporate Bond Fund	U.S. Government Bond Fund	U.S. Growth Fund	U.S. Total Return Bond Fund	U.S. Value Fund
A1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	0,86 %	S/O	S/O	S/O
A1 (USD)	(0,71) %	13,80 %	3,66 %	0,24 %	29,36 %	2,19 %	3,66 %
A2 (USD)	S/O	S/O	3,68 %	0,20 %	S/O	2,17 %	S/O
AH1 (EUR)	S/O	S/O	1,69 %	(1,94) %	26,45 %	0,11 %	1,51 %
C1 (USD)	(1,43) %	12,94 %	2,64 %	(0,89) %	28,43 %	1,18 %	2,88 %
C2 (USD)	S/O	S/O	2,70 %	(0,91) %	S/O	1,10 %	S/O
I1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	31,58 %	S/O	5,41 %
I1 (GBP)	(2,33) %	11,78 %	S/O	S/O	27,25 %	S/O	1,94 %
I1 (USD)	0,41 %	14,91 %	4,49 %	0,71 %	30,82 %	2,89 %	4,79 %
I2 (GBP)	(2,33) %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
IH1 (EUR)	S/O	S/O	2,37 %	S/O	27,98 %	0,82 %	2,55 %
IH2 (EUR)	S/O	S/O	S/O	(1,38) %	S/O	S/O	S/O
IS1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	3,94 % (a)	S/O
N1 (USD)	(1,17) %	13,20 %	3,23 %	(0,42) %	28,72 %	1,70 %	3,17 %
N2 (USD)	S/O	S/O	3,15 %	(0,29) %	S/O	1,72 %	S/O
P1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	3,68 %
PH1 (EUR)	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	1,41 %
S1 (USD)	S/O	15,02 %	S/O	0,52 %	S/O	2,74 %	4,62 %
W1 (GBP)	(2,44) %	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O	S/O
W1 (USD)	0,26 %	14,82 %	4,42 %	0,59 %	30,72 %	2,78 %	4,73 %
W2 (USD)	S/O	S/O	4,41 %	0,63 %	S/O	2,85 %	S/O
WH1 (EUR)	S/O	12,19 %	2,37 %	S/O	27,85 %	0,62 %	2,70 %
WH1 (GBP)	S/O	14,20 %	3,74 %	S/O	29,68 %	2,23 %	3,86 %
Z1 (USD)	S/O	S/O	S/O	S/O	31,74 %	S/O	S/O

(a) La performance correspond à la période allant du début des activités de la catégorie à la fin de la période indiquée. Voir la note 18 pour de plus amples informations.

(c) Le compartiment a commencé ses activités le 13 septembre 2023.

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES PERFORMANCES

Les données de performance indiquées représentent les performances passées et ne préjugent pas des résultats futurs. Le rendement des investissements et la valeur du principal fluctuent, de sorte que, lorsque vous les revendrez, vos actions pourront avoir une valeur supérieure ou inférieure à leur coût d'origine ; la performance actuelle peut être inférieure ou supérieure au rendement indiqué. Pour obtenir la performance de fin de mois la plus récente, veuillez contacter votre conseiller financier.

Les résultats de performance reflètent toutes subventions et dérogations de charges applicables qui étaient en vigueur pendant les périodes indiquées. Sans ces subventions et dérogations, les performances des compartiments auraient été moins favorables. Veuillez vous reporter au prospectus et aux états financiers pour plus de détails. Tous les résultats sont de nature historique et supposent le réinvestissement des dividendes et des plus-values distribués, le cas échéant.

Les rendements totaux ne comprennent pas les commissions de vente applicables. Si ces commissions avaient été prises en considération, les résultats auraient été inférieurs.

Les évolutions des taux de change peuvent influencer sur les valeurs nettes d'inventaire par action et sur la performance des catégories d'actions libellées dans d'autres devises que la devise de référence d'un compartiment.

Les résultats de la performance ne tiennent pas compte des ajustements effectués à des fins de reporting financier.

Les résultats de performance comprennent l'impact du « swing pricing », le cas échéant. Voir la Note 3 de la rubrique « Notes aux états financiers » pour de plus amples informations.

Les compartiments peuvent recevoir, en tant que de besoin, les produits issus du règlement de litiges, sans lesquels les performances seraient inférieures.

INFORMATIONS GÉNÉRALES

Les états financiers annuels révisés et semestriels non révisés sont disponibles au siège social du fonds et sur meridian.mfs.com.

Les convocations aux assemblées générales sont publiées au *Mémorial – Journal Officiel du Grand-Duché de Luxembourg*, ainsi que dans d'autres journaux publiés dans les juridictions où le fonds est enregistré ou dans d'autres publications telles que déterminées par les administrateurs.

La liste des changements intervenus dans les portefeuilles au cours de la période close le 31 janvier 2024 est disponible gratuitement au siège social du fonds.

Les informations concernant les valeurs nettes d'inventaire des compartiments et les achats et ventes de titres sont disponibles au siège social du fonds.

Les Statuts ont été déposés au Greffe du Tribunal d'Arrondissement de et à Luxembourg, sur meridian.mfs.com et au siège social du fonds, où ils peuvent être consultés et où il est possible d'en obtenir des exemplaires sur demande.

Les documents d'offre les plus récents du fonds, y compris les Documents d'informations clés (DIC), les Key Facts Statements (KFS) pour les investisseurs à Hong Kong et les prospectus, contiennent des informations sur les objectifs d'investissement, les charges, les frais et les risques des compartiments. Les documents d'offre, les Statuts, les rapports financiers et les autres informations concernant le fonds sont mis à la disposition des investisseurs, sans frais, au siège social du fonds, auprès de votre intermédiaire financier, ou en ligne sur www.meridian.mfs.com. Veuillez les lire soigneusement avant d'investir. Veuillez également noter que tous les compartiments ou toutes les catégories d'actions ne sont pas nécessairement enregistrés ou agréés pour la distribution dans toutes les juridictions. Dans certaines juridictions, un investissement peut uniquement être effectué par un investisseur qualifié et/ou par le biais d'un intermédiaire agréé sur la base d'un placement privé limité, en fonction des dispositions législatives et réglementaires applicables dans le pays de distribution. Veuillez noter qu'à compter du 31 janvier 2024, le Contrarian Value Fund, les compartiments Contrarian Value Fund, Diversified Income Fund, Emerging Markets Debt Local Currency Fund, Emerging Markets Equity Research Fund, Euro Credit Fund, Global Credit Fund, Global Equity Income Fund, Global Intrinsic Value Fund, Global Listed Infrastructure Fund, Global New Discovery Fund, Global Opportunistic Bond Fund, Global Strategic Equity Fund, Managed Wealth Fund, Prudent Capital Fund, U.S. Corporate Bond Fund, U.S. Equity Income Fund et U.S. Growth Fund n'étaient pas enregistrés à Hong Kong et qu'ils n'étaient donc pas offerts au public dans cette juridiction.

GOVERNANCE D'ENTREPRISE

CODE DE CONDUITE DE L'ALFI

Le fonds s'engage à adhérer à des normes de gouvernance d'entreprise à l'égard de sa gestion. Pour ce faire, il adhère au Code de Conduite des Fonds d'Investissement Luxembourgeois de l'ALFI (Association Luxembourgeoise des Fonds d'Investissement), qui a été publié en septembre 2009 avant d'être mis à jour et republié en 2022. Ce Code énonce les principes concernant le personnel qualifié et expérimenté, les conflits d'intérêts et l'obligation de servir au mieux les intérêts des actionnaires, les procédures de due diligence et la surveillance, le respect des lois applicables et les processus de gestion du risque.

RÉCLAMATIONS OU QUESTIONS DES ACTIONNAIRES

Si vous souhaitez adresser une réclamation sur un aspect du service que vous avez reçu, vous pouvez contacter votre agent local dans votre pays ou encore l'agent de transfert des compartiments auprès de State Street Bank International GmbH, Succursale du Luxembourg, par courrier, téléphone ou e-mail.

Courrier : MFS Meridian Funds c/o State Street Bank International GmbH, Succursale du Luxembourg
49, avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Téléphone : Europe et Asie : +352-46-40-10-600
Amériques : +1-416-506-8418

E-mail : Europe et Asie : MFSquerydesk@statestreet.com
Amériques : mfsdealerservices@ifdsgroup.com

Pour de plus amples informations sur le processus de traitement des réclamations du fonds, veuillez consulter le site www.meridian.mfs.com.

COMMUNICATION DE CERTAINES INFORMATIONS SUR LA GESTION DU RISQUE (non révisées)

Informations concernant l'exposition globale en application du Programme de Gestion du Risque des Compartiments

La Société de gestion du fonds doit avoir recours à un processus de gestion du risque qui lui permet de suivre et de mesurer à tout moment le risque des positions des portefeuilles des compartiments et leur contribution au profil de risque global de chaque portefeuille. L'exposition globale liée aux instruments financiers dérivés peut être calculée au moyen de l'« approche par les engagements » ou de la méthodologie de la Valeur-en-Risque (« VaR »). De manière générale, un compartiment qui utilise les instruments dérivés sur une plus grande échelle ou dans le cadre de son objectif d'investissement a recours à la méthodologie de la VaR et un compartiment qui utilise les instruments dérivés sur une plus

petite échelle a recours à l'approche par les engagements.

Pour chaque compartiment, à l'exception des compartiments Emerging Markets Debt Local Currency Fund, Euro Credit Fund, Global Credit Fund, Global Opportunistic Bond Fund et Managed Wealth Fund, l'approche par les engagements est utilisée pour calculer l'exposition globale. L'approche par les engagements est basée, en partie, sur le principe consistant à convertir l'exposition des instruments dérivés en positions équivalentes des actifs sous-jacents et à quantifier l'exposition en valeur absolue du total des engagements (la couverture et la compensation pouvant être prises en considération).

Pour le Managed Wealth Fund, une méthode de Valeur-en-Risque (« VaR ») absolue est utilisée, tandis que pour les compartiments Emerging Markets Debt Local Currency Fund, Euro Credit Fund, Global Credit Fund, et Global Opportunistic Bond Fund, une méthode de VaR relative est employée pour mesurer l'exposition globale. La VaR constitue une mesure de la perte potentielle minimale pouvant survenir sur un intervalle donné dans des conditions de marché normales et à un niveau de confiance donné. Le Programme de Gestion du Risque des Compartiments limite la VaR maximale que le compartiment concerné peut atteindre, par rapport à sa valeur nette d'inventaire pour la VaR absolue ou par rapport à son indicateur de référence pour la VaR relative, tel que déterminé par le compartiment compte tenu de sa politique d'investissement et de son profil de risque. Pour le compartiment Managed Wealth Fund, la VaR absolue ne peut être supérieure à 20 % de sa valeur nette d'inventaire. Pour les compartiments Emerging Markets Debt Local Currency Fund, Euro Credit Fund, Global Credit Fund, et Global Opportunistic Bond Fund, la VaR relative ne peut être supérieure à 200 % de leur indicateur de référence actuel. La méthode de VaR utilisée par chacun de ces compartiments est basée sur un modèle historique. La VaR est mesurée quotidiennement au niveau de confiance de 99 % en fonction d'une période de détention d'un mois (20 jours). La série de données sous-jacentes comprend un an de données (minimum de 250 observations).

Pour le compartiment Emerging Markets Debt Local Currency Fund, le niveau d'effet de levier prévu peut varier entre 0 % et 375 % (mesuré au moyen de la somme de la valeur notionnelle des instruments dérivés utilisés par le compartiment) de sa valeur nette. En outre, la Société de Gestion suit d'une manière complémentaire le niveau d'effet de levier attendu mesuré au moyen de l'approche par les engagements, lequel peut varier entre 0 % et 125 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Dans certaines circonstances, telles que des conditions de marché exceptionnelles ou des facteurs opérationnels temporaires, le niveau d'effet de levier pourrait dépasser les fourchettes indiquées ci-dessus.

Pour le compartiment Euro Credit Fund, le niveau d'effet de levier prévu peut varier entre 0 % et 275 % (mesuré au moyen de la somme de la valeur notionnelle des instruments dérivés utilisés par le compartiment) sur la base de sa valeur nette d'inventaire. En outre, la Société de Gestion suit d'une manière complémentaire le niveau d'effet de levier attendu mesuré au moyen de l'approche par les engagements, lequel peut varier entre 0 % et 125 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Dans certaines circonstances, telles que des conditions de marché exceptionnelles ou des facteurs opérationnels temporaires, le niveau d'effet de levier pourrait dépasser les fourchettes indiquées ci-dessus.

Pour le compartiment Global Credit Fund, le niveau d'effet de levier prévu peut varier entre 0 % et 275 % (mesuré au moyen de la somme de la valeur notionnelle des instruments dérivés utilisés par le compartiment) sur la base de sa valeur nette d'inventaire. En outre, la Société de Gestion suit d'une manière complémentaire le niveau d'effet de levier attendu mesuré au moyen de l'approche par les engagements, lequel peut varier entre 0 % et 125 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Dans certaines circonstances, telles que des conditions de marché exceptionnelles ou des facteurs opérationnels temporaires, le niveau d'effet de levier pourrait dépasser les fourchettes indiquées ci-dessus.

Pour le compartiment Global Opportunistic Bond Fund, le niveau d'effet de levier prévu peut varier entre 0 % et 400 % (mesuré au moyen de la somme de la valeur notionnelle des instruments dérivés utilisés par le compartiment) de sa valeur nette. En outre, la Société de Gestion suit d'une manière complémentaire le niveau d'effet de levier attendu mesuré au moyen de l'approche par les engagements, lequel peut varier entre 0 % et 200 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Dans certaines circonstances, telles que des conditions de marché exceptionnelles ou des facteurs opérationnels temporaires, le niveau d'effet de levier pourrait dépasser les fourchettes indiquées ci-dessus.

Pour le compartiment Managed Wealth Fund, le niveau d'effet de levier prévu peut varier entre 0 % et 200 % (mesuré au moyen de la somme de la valeur notionnelle des instruments dérivés utilisés par le compartiment) de sa valeur nette. En outre, la Société de Gestion suit d'une manière complémentaire le niveau d'effet de levier attendu mesuré au moyen de l'approche par les engagements, lequel peut varier entre 0 % et 100 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment. Dans certaines circonstances, telles que des conditions de marché exceptionnelles ou des facteurs opérationnels temporaires, le niveau d'effet de levier pourrait dépasser les fourchettes indiquées ci-dessus.

La somme de la valeur notionnelle est la somme des valeurs absolues des expositions sous-jacents totales de nos positions dérivées. Elle est basée sur l'exposition notionnelle totale sans compensation ni couverture. Suivant les deux méthodologies de niveau d'effet de levier, la somme des expositions absolues est calculée de manière à ce que des expositions de signe opposé à des actifs non liés ne se compensent pas au final.

Veuillez consulter le tableau ci-dessous pour une synthèse des informations concernant les résultats quotidiens de la VaR et de l'effet de levier au titre des compartiments Emerging Markets Debt Local Currency Fund, Euro Credit Fund, Global Credit Fund, Global Opportunistic Bond Fund et Managed Wealth Fund entre le 1^{er} février 2023 et la clôture de l'exercice le 31 janvier 2024 :

1 ^{er} février 2023 – 31 janvier 2024	Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Euro Credit Fund	Global Credit Fund	Global Opportunistic Bond Fund
VaR relative la plus basse	99,26 %	75,67 %	89,79 %	71,32 %
VaR relative la plus élevée	142,08 %	134,45 %	120,74 %	119,05 %
VaR relative moyenne	113,52 %	101,83 %	105,70 %	97,72 %
Niveau d'effet de levier le plus bas (somme de la valeur notionnelle)	63,67 %	43,50 %	52,03 %	139,32 %
Niveau d'effet de levier le plus haut (somme de la valeur notionnelle)	236,84 %	120,28 %	147,37 %	354,65 %
Niveau d'effet de levier moyen (somme de la valeur notionnelle)	126,99 %	69,56 %	81,85 %	195,06 %
Niveau d'effet de levier le plus bas (approche par les engagements)	50,13 %	22,82 %	29,73 %	49,27 %
Niveau d'effet de levier le plus haut (approche par les engagements)	119,96 %	46,15 %	50,63 %	78,62 %
Niveau d'effet de levier moyen (approche par les engagements)	86,93 %	34,35 %	39,56 %	64,15 %

1 ^{er} février 2023 – 31 janvier 2024	Managed Wealth Fund
VaR absolue la plus basse	1,55 %
VaR absolue la plus élevée	3,27 %
VaR absolue moyenne	2,34 %
Niveau d'effet de levier le plus bas (somme de la valeur notionnelle)	76,42 %
Niveau d'effet de levier le plus haut (somme de la valeur notionnelle)	101,76 %
Niveau d'effet de levier moyen (somme de la valeur notionnelle)	86,15 %
Niveau d'effet de levier le plus bas (approche par les engagements)	63,29 %
Niveau d'effet de levier le plus haut (approche par les engagements)	83,21 %
Niveau d'effet de levier moyen (approche par les engagements)	73,38 %

RÈGLEMENT EUROPÉEN SUR LA PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ DANS LE SECTEUR DES SERVICES FINANCIERS (« SFDR ») (NON AUDITÉ)

À compter de la date du présent rapport, les compartiments suivants de MFS Meridian Funds ont été désignés comme répondant aux critères de l'Article 8 en vertu du SFDR :

Blended Research European Equity	European Value Fund	Limited Maturity Fund
Continental European Equity Fund	Global Concentrated Fund	Managed Wealth Fund
Contrarian Value Fund	Global Credit Fund	Prudent Capital Fund
Diversified Income Fund	Global Equity Fund	Prudent Wealth Fund
Emerging Markets Debt Fund	Global Equity Income Fund	U.K. Equity Fund
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Global Intrinsic Value Fund	U.S. Concentrated Growth Fund
Euro Credit Fund	Global Listed Infrastructure Fund	U.S. Corporate Bond Fund
European Core Equity Fund	Global Opportunistic Bond Fund	U.S. Growth Fund
European Research Fund	Global Research Focused Fund	U.S. Total Return Bond Fund
European Smaller Companies Fund	Global Strategic Equity Fund	U.S. Value Fund
	Global Total Return Fund	

Ces compartiments favorisent la caractéristique MFS Low Carbon Transition. De plus amples informations sur la caractéristique sont disponibles sur le site Web du SFDR concerné, accessible à l'adresse meridian.mfs.com (sélectionnez l'emplacement et le fonds de l'Article 8 applicable pour le document d'information du fonds de l'Article 8 du SFDR).

La mesure dans laquelle chaque compartiment a respecté les critères climatiques sous-jacents à la date du présent rapport est disponible dans l'Annexe SFDR jointe au présent rapport, accessible à l'adresse meridian.mfs.com (sélectionnez l'emplacement et le fonds de l'Article 8 applicable pour le document d'information du fonds de l'Article 8 du SFDR).

Ni les fonds MFS Meridian de l'Article 8 susmentionnés, ni les autres compartiments de MFS Meridian Funds, ne prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement sur la Taxonomie et l'alignement du portefeuille avec ce règlement n'est pas calculé.

Les autres compartiments sont actuellement classés en vertu de l'Article 6 du SFDR et ne tiennent pas compte des critères de l'UE pour les activités économiques durables sur le plan environnemental.

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Asia Ex-Japan Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Singapore Technologies Engineering Ltd.	181 700	502 111	1,47
Boissons alcoolisées			
China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	94 000	338 465	0,99
Kweichow Moutai Co. Ltd., "A"	3 100	689 219	2,02
Wuliangye Yibin Co. Ltd., "A"	8 900	155 927	0,45
		1 183 611	3,46
Industrie de la confection			
Li Ning Co. Ltd.	52 000	110 413	0,33
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	38 800	346 165	1,01
		456 578	1,34
Industrie automobile			
BYD Co. Ltd.	19 500	434 749	1,27
Mahindra & Mahindra Ltd.	26 562	525 955	1,54
Maruti Suzuki India Ltd.	2 984	364 949	1,07
		1 325 653	3,88
Biotechnologies			
Hugel, Inc.	2 552	290 641	0,85
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	10 900	330 617	0,97
Services aux entreprises			
Infosys Ltd.	40 941	817 192	2,39
Tata Consultancy Services Ltd.	11 872	545 531	1,60
		1 362 723	3,99
Produits chimiques			
UPL Ltd.	92 903	599 775	1,75
Logiciels			
Kingsoft Corp.	69 200	167 646	0,49
Logiciels - Systèmes			
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	105 000	342 486	1,00
Samsung Electronics Co. Ltd.	54 110	2 934 100	8,59
		3 276 586	9,59
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	190 500	382 075	1,12
Midea Group Co. Ltd., "A"	67 500	547 649	1,60
Techtronic Industries Co. Ltd.	60 000	640 982	1,88
		1 570 706	4,60
Biens de consommation			
AmorePacific Corp.	6 171	539 678	1,58
Services de consommation			
Trip.com Group Ltd., ADR	9 297	339 898	0,99
Équipements électriques			
Advantech Co. Ltd.	40 094	430 552	1,26
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd., "A"	13 580	285 229	0,83
		715 781	2,09
Électronique			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	163 814	3 281 689	9,60
Énergie - Sociétés indépendantes			
Reliance Industries Ltd.	28 998	993 290	2,91
Énergie - Sociétés intégrées			
PetroChina Co. Ltd.	340 000	243 549	0,71
Énergie - Renouvelables			
LONGi Green Energy Technology Co., Ltd., "A"	22 500	60 529	0,18
Ingénierie - Construction			
Doosan Bobcat, Inc.	7 045	264 975	0,77

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Asia Ex-Japan Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Alimentation et boissons			
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd., "A"	134 963	507 604	1,48
Jeux et hôtellerie			
Sands China Ltd.	164 400	431 085	1,26
Assurances			
AIA Group Ltd.	149 400	1 161 668	3,40
Ping An Insurance Co. of China Ltd., "H"	75 500	318 584	0,93
Prudential PLC	13 240	136 420	0,40
		1 616 672	4,73
Internet			
NAVER Corp.	1 713	253 294	0,74
NetEase, Inc.	24 525	478 780	1,40
Tencent Holdings Ltd.	49 400	1 718 136	5,03
		2 450 210	7,17
Machines et outils			
AirTAC International Group	9 000	268 508	0,79
Delta Electronics, Inc.	32 000	284 545	0,83
		553 053	1,62
Grandes banques			
Bandhan Bank Ltd.	209 175	573 631	1,68
DBS Group Holdings Ltd.	29 000	686 659	2,01
		1 260 290	3,69
Métaux et exploitation minière			
PT United Tractors Tbk	253 400	368 538	1,08
Gaz naturel - Distribution			
China Resources Gas Group Ltd.	171 800	485 649	1,42
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Bangkok Bank Public Co. Ltd.	93 300	368 177	1,08
Bank Negara Indonesia PT	2 594 000	945 215	2,76
China Merchants Bank Co. Ltd.	29 500	107 506	0,31
China Merchants Bank Co. Ltd. "A"	151 029	646 945	1,89
HDFC Bank Ltd.	22 628	396 083	1,16
IndusInd Bank Ltd.	29 289	538 940	1,58
Kasikornbank Co. Ltd.	91 400	306 577	0,90
KB Financial Group, Inc.	17 938	760 717	2,23
Kotak Mahindra Bank Ltd.	36 731	804 532	2,35
		4 874 692	14,26
Produits pharmaceutiques			
Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	11 657	199 110	0,58
Immobilier			
Capitaland Investment Ltd.	127 800	280 345	0,82
Restaurants			
Jollibee Foods Corp.	76 620	345 435	1,01
Yum China Holdings, Inc.	12 792	442 475	1,29
		787 910	2,30
Magasins spécialisés			
Alibaba Group Holding Ltd.	112 736	1 011 968	2,96
PDD Holdings, Inc., ADR	1 200	152 244	0,45
		1 164 212	3,41
Télécommunications mobiles			
Advanced Info Service Public Co. Ltd.	77 200	474 374	1,39
PT Telekom Indonesia	1 442 500	361 996	1,06
		836 370	2,45
Services publics - Énergie électrique			
CLP Holdings Ltd.	49 000	388 420	1,14
Total des actions ordinaires (coût identifié, 38 431 911 \$)		33 710 196	98,63

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Asia Ex-Japan Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)			
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 100 000 \$)	USD 100 000	99 985	0,29
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 38 531 911 \$) (k)		33 810 181	98,92
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		369 969	1,08
ACTIF NET		34 180 150	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Blended Research European Equity Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Babcock International Group PLC	13 625	72 102	0,90
Rolls-Royce Holdings PLC	30 644	107 767	1,35
Thales S.A.	189	25 581	0,32
		205 450	2,57
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	562	69 476	0,87
Industrie de la confection			
Adidas AG	595	104 791	1,31
Burberry Group PLC	3 330	51 077	0,64
Christian Dior S.A.	48	35 154	0,44
Compagnie Financiere Richemont S.A.	499	69 024	0,87
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	127	97 739	1,22
		357 785	4,48
Industrie automobile			
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	2 966	91 412	1,15
Stellantis N.V.	5 934	120 956	1,51
Trelleborg AB	1 053	29 521	0,37
		241 889	3,03
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
3i Group PLC	2 646	76 410	0,96
IG Group Holdings PLC	7 045	58 387	0,73
		134 797	1,69
Services aux entreprises			
Experian PLC	1 860	71 754	0,90
Serco Group PLC	32 233	65 020	0,81
		136 774	1,71
Logiciels			
Dassault Systemes SE	2 521	121 601	1,52
SAP SE	118	19 002	0,24
		140 603	1,76
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	576	37 258	0,47
Cap Gemini S.A.	487	100 906	1,26
Logitech International	705	54 667	0,68
		192 831	2,41
Construction			
Compagnie de Saint-Gobain S.A.	2 097	137 409	1,72
Heidelberg Materials AG	900	77 292	0,97
		214 701	2,69

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Blended Research European Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Biens de consommation			
Reckitt Benckiser Group PLC	1 532	102 368	1,28
Unilever PLC	1 592	71 722	0,90
		174 090	2,18
Équipements électriques			
Legrand S.A.	1 084	97 536	1,22
Schneider Electric SE	998	182 006	2,28
Siemens AG	97	16 168	0,20
		295 710	3,70
Électronique			
ASML Holding N.V.	475	376 698	4,71
NXP Semiconductors N.V.	212	41 307	0,52
		418 005	5,23
Énergie - Sociétés intégrées			
Eni S.p.A.	9 907	146 625	1,83
Shell PLC	2 047	58 807	0,74
TotalEnergies SE	3 443	207 491	2,60
		412 923	5,17
Alimentation et boissons			
Coca-Cola Europacific Partners PLC	1 079	68 792	0,86
Danone S.A.	1 123	69 334	0,87
Nestlé S.A.	2 675	282 224	3,53
		420 350	5,26
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Jeronimo Martins SGPS S.A.	818	17 244	0,21
Tesco PLC	40 374	135 543	1,70
		152 787	1,91
Jeux et hôtellerie			
Whitbread PLC	1 963	82 426	1,03
Marchandises générales			
B&M European Value Retail S.A.	7 397	44 806	0,56
Assurances			
Beazley PLC	11 599	74 062	0,93
Hannover Rueck SE	141	31 283	0,39
Hiscox Ltd.	6 538	79 659	1,00
SCOR SE	1 280	35 337	0,44
Zurich Insurance Group AG	246	115 826	1,45
		336 167	4,21
Internet			
Moneysupermarket.com Group PLC	12 596	37 638	0,47
Scout24 AG	1 627	111 529	1,40
		149 167	1,87
Machines et outils			
GEA Group AG	2 380	88 536	1,11
Volvo Group	5 475	120 984	1,51
		209 520	2,62
Grandes banques			
ABN AMRO Group N.V., GDR	7 253	99 249	1,24
Bank of Ireland Group PLC	8 463	71 857	0,90
BNP Paribas	2 224	138 377	1,73
Danske Bank A.S.	3 796	94 541	1,18
Erste Group Bank AG	2 557	102 408	1,28
HSBC Holdings PLC	2 967	21 421	0,27
UBS Group AG	6 243	172 534	2,16
UniCredit S.p.A.	4 222	114 669	1,44
		815 056	10,20

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Blended Research European Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Technologies et services médicaux et de santé			
Fresenius Medical Care AG	1 531	55 116	0,69
Équipements médicaux			
Demant A.S.	2 083	87 374	1,09
Qiagen N.V.	1 117	45 105	0,57
		132 479	1,66
Métaux et exploitation minière			
Glencore PLC	19 646	96 864	1,21
Rio Tinto PLC	2 385	153 909	1,93
		250 773	3,14
Gaz naturel - Distribution			
Centrica PLC	32 533	52 712	0,66
Services pétroliers			
Tenaris S.A.	6 656	97 634	1,22
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Julius Baer Group Ltd.	1 214	61 348	0,77
Produits pharmaceutiques			
AstraZeneca PLC	468	57 625	0,72
Bayer AG	1 053	30 332	0,38
Novartis AG	2 353	225 563	2,82
Novo Nordisk A.S., "B"	2 077	219 501	2,75
Roche Holding AG	911	240 852	3,01
Sanofi	1 970	183 039	2,29
		956 912	11,97
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	1 034	141 141	1,76
Immobilier			
Safestore Holdings PLC, REIT	4 411	42 291	0,53
TAG Immobilien AG	6 160	80 441	1,00
		122 732	1,53
Restaurants			
Sodexo	474	49 580	0,62
Wetherspoons (J.D.) PLC	6 354	62 591	0,78
		112 171	1,40
Produits chimiques spéciaux			
Air Liquide S.A.	887	153 843	1,92
Magasins spécialisés			
NEXT PLC	628	62 120	0,78
Services téléphoniques			
Koninklijke KPN N.V.	25 550	80 431	1,01
Tabac			
British American Tobacco PLC	4 444	121 429	1,52
Services publics - Énergie électrique			
A2A S.p.A.	26 506	48 566	0,61
E.ON SE	6 725	84 466	1,06
Iberdrola S.A.	13 421	149 625	1,87
		282 657	3,54
Total des actions ordinaires (coût identifié, 6 973 206 €)		7 888 811	98,72

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Blended Research European Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 3,82 % (v) (coût identifié, 162 677 €)	163 126	163 126	2,04
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 7 135 883 €) (k)		8 051 937	100,76
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		(60 556)	(0,76)
ACTIF NET		7 991 381	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Continental European Equity Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Heineken N.V.	18 053	1 681 251	2,17
Pernod Ricard S.A.	9 269	1 411 598	1,83
		3 092 849	4,00
Industrie de la confection			
Kering S.A.	2 185	834 027	1,08
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	4 708	3 623 250	4,69
		4 457 277	5,77
Industrie automobile			
Continental AG	8 148	619 735	0,80
Radio-télévision			
Publicis Groupe S.A.	13 856	1 286 931	1,67
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Deutsche Boerse AG	8 843	1 633 744	2,11
Logiciels			
Dassault Systemes SE	29 505	1 423 174	1,84
SAP SE	29 753	4 791 253	6,21
		6 214 427	8,05
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	35 103	2 270 575	2,94
Cap Gemini S.A.	17 979	3 725 249	4,82
		5 995 824	7,76
Construction			
Kingspan Group PLC	6 869	519 022	0,67
Biens de consommation			
L'Oréal S.A.	3 502	1 553 913	2,01
Équipements électriques			
Schneider Electric SE	24 956	4 551 234	5,89
Énergie - Sociétés intégrées			
Galp Energia SGPS S.A., "B"	56 203	815 618	1,06
Ingénierie - Construction			
Arcadis N.V.	21 107	1 070 310	1,39
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	24 748	1 527 941	1,98
Nestlé S.A.	39 954	4 215 322	5,46
		5 743 263	7,44
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	302	57 459	0,07
Flutter Entertainment PLC	9 431	1 812 022	2,35
		1 869 481	2,42

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Continental European Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Internet			
Scout24 AG	11 071	758 907	0,98
Machines et outils			
Assa Abloy AB	93 017	2 361 485	3,06
GEA Group AG	35 261	1 311 709	1,70
		3 673 194	4,76
Grandes banques			
Bank of Ireland Group PLC	101 209	859 339	1,11
Erste Group Bank AG	13 357	534 948	0,69
ING Groep N.V.	94 236	1 240 288	1,61
UBS Group AG	68 737	1 899 644	2,46
		4 534 219	5,87
Technologies et services médicaux et de santé			
Alcon, Inc.	7 946	551 430	0,71
Équipements médicaux			
EssilorLuxottica	12 877	2 342 658	3,03
QIAGEN N.V.	29 713	1 197 928	1,55
Sonova Holding AG	2 966	875 821	1,14
		4 416 407	5,72
Réseaux et télécommunications			
LM Ericsson Telephone Co., "B"	120 475	616 152	0,80
Services pétroliers			
Tenaris S.A.	61 382	900 389	1,17
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
AIB Group PLC	342 416	1 389 170	1,80
Allfunds Group PLC	82 090	543 123	0,70
Julius Baer Group Ltd.	17 174	867 866	1,13
Komerční banka A.S.	16 086	489 094	0,63
		3 289 253	4,26
Produits pharmaceutiques			
Bayer AG	11 687	336 643	0,44
Merck KGaA	6 198	944 575	1,22
Novartis AG	37 373	3 582 652	4,64
Roche Holding AG	14 909	3 941 672	5,10
		8 805 542	11,40
Restaurants			
Sodexo	17 766	1 858 324	2,41
Produits chimiques spéciaux			
Akzo Nobel N.V.	3 018	213 737	0,28
Linde PLC	9 175	3 436 952	4,45
Sika AG	4 698	1 199 913	1,55
		4 850 602	6,28
Services publics - Énergie électrique			
Fortum Corp.	38 899	490 823	0,63
Total des actions ordinaires (coût identifié, 68 400 835 €)		74 168 870	96,03
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 3,82 % (v) (coût identifié, 2 519 218 €)	2 524 634	2 524 634	3,27
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 70 920 053 €) (k)		76 693 504	99,30
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		536 879	0,70
ACTIF NET		77 230 383	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Contrarian Value Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Babcock International Group PLC	2 710 003	15 498 199	2,24
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	171 570	22 921 752	3,31
Industrie de la confection			
Adidas AG	65 333	12 435 021	1,79
Industrie automobile			
Autoliv, Inc.	184 998	19 816 986	2,86
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	601 421	20 031 638	2,89
		39 848 624	5,75
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Citigroup, Inc.	154 709	8 690 005	1,25
Services aux entreprises			
Intertek Group PLC	313 466	17 784 436	2,57
Logiciels - Systèmes			
Samsung Electronics Co. Ltd.	378 802	20 540 435	2,96
Biens de consommation			
Reckitt Benckiser Group PLC	254 943	18 409 997	2,66
Équipements électriques			
Mitsubishi Electric Corp.	1 061 100	15 626 428	2,26
Signify N.V.	710 452	21 459 608	3,10
Spectris PLC	430 765	20 123 180	2,90
		57 209 216	8,26
Électronique			
Kyocera Corp.	536 000	7 854 541	1,13
Énergie - Sociétés intégrées			
Cenovus Energy, Inc.	1 430 031	23 166 406	3,34
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	333 549	22 255 200	3,21
Novozymes A/S	660 336	33 834 200	4,89
		56 089 400	8,10
Assurances			
Swiss Re Ltd.	145 651	16 726 362	2,41
Machines et outils			
Assa Abloy AB	858 826	23 563 147	3,40
Toyota Industries Corp.	159 400	13 462 841	1,94
Weir Group PLC	915 691	21 114 486	3,05
		58 140 474	8,39
Grandes banques			
ABN AMRO Group N.V., GDR	691 980	10 233 077	1,48
Bank of America Corp.	297 272	10 110 221	1,46
Bank of Ireland Group PLC	1 439 874	13 212 202	1,91
BNP Paribas	151 737	10 202 919	1,47
NatWest Group PLC	5 397 781	15 307 074	2,21
Resona Holdings, Inc.	2 385 700	13 238 976	1,91
		72 304 469	10,44
Équipements médicaux			
Medtronic PLC	215 127	18 832 218	2,72
Métaux et exploitation minière			
Anglo American PLC	702 040	16 663 360	2,40
ArcelorMittal S.A.	714 394	19 592 371	2,83
Teck Resources	465 884	18 646 449	2,69
		54 902 180	7,92
Chemins de fer et transport maritime			
CSX Corp.	554 190	19 784 583	2,86

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Contrarian Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Magasins spécialisés			
NEXT PLC	173 703	18 568 682	2,68
Zalando SE	783 928	15 825 531	2,28
		34 394 213	4,96
Services publics - Énergie électrique			
Fortum Corp.	1 607 938	21 926 082	3,16
National Grid PLC	1 291 144	17 186 575	2,48
		39 112 657	5,64
Services publics - Eau			
Veolia Environnement S.A.	561 220	18 280 351	2,64
Total des actions ordinaires (coût identifié, 593 111 493 \$)		632 925 539	91,34
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)			
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 4 963 000 \$)	USD 4 963 000	4 962 283	0,72
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 598 074 493 \$) (k)		637 887 822	92,06
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		55 021 295	7,94
ACTIF NET		692 909 117	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS			
Aérospatiale et défense			
Bombardier, Inc., 7,125 %, 15/06/2026	USD 29 000	29 242	0,04
Bombardier, Inc., 7,5 %, 1/02/2029	26 000	26 501	0,04
Bombardier, Inc., 8,75 %, 15/11/2030	18 000	18 890	0,03
General Dynamics Corp., 3,625 %, 1/04/2030	45 000	42 835	0,06
L3 Harris Technologies, Inc., 5,4 %, 15/01/2027	65 000	66 290	0,09
L3 Harris Technologies, Inc., 5,4 %, 31/07/2033	63 000	64 892	0,09
Moog, Inc., 4,25 %, 15/12/2027	65 000	60 861	0,08
Spirit AeroSystems, Inc., 9,75 %, 15/11/2030	80 000	83 965	0,11
TransDigm, Inc., 6,25 %, 15/03/2026	57 000	56 612	0,08
TransDigm, Inc., 5,5 %, 15/11/2027	33 000	32 106	0,04
TransDigm, Inc., 6,75 %, 15/08/2028	55 000	55 900	0,08
TransDigm, Inc., 4,625 %, 15/01/2029	72 000	67 325	0,09
TransDigm, Inc., 6,875 %, 15/12/2030	108 000	110 528	0,15
		715 947	0,98
Compagnies aériennes			
Air Canada, 3,875 %, 15/08/2026	87 000	82 744	0,11
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd., 5,75 %, 20/04/2029	55 284	54 290	0,08
		137 034	0,19
Industrie de la confection			
Tapestry, Inc., 4,125 %, 15/07/2027	21 000	19 969	0,03
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032	18 000	14 396	0,02
Wolverine World Wide, Inc., 4 %, 15/08/2029	40 000	32 232	0,04
		66 597	0,09
Créances adossées à des actifs et titrisées			
ACREC 2023-FL2 LLC, "A", FLR, 7,563 %, 19/02/2038	100 000	99 959	0,14
Commercial Mortgage Trust, 2017-COR2, "A3", 3,51 %, 10/09/2050	77 616	72 990	0,10
Consumers 2023 Securitization Funding LLC, 5,55 %, 1/03/2028	23 000	23 092	0,03
Flagship Credit Auto Trust, 2019-3, "D", 2,86 %, 15/12/2025	12 033	11 912	0,02

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
GS Mortgage Securities Trust, 2015-GC30, "A4", 3,382 %, 10/05/2050	USD	75 000	72 734	0,10
KREF 2018-FT1 Ltd., "A", FLR, 6,516 %, 15/02/2039		100 000	98 655	0,14
KREF 2018-FT1 Ltd., "AS", FLR, 6,746 %, 15/02/2039		100 000	96 181	0,13
LAD Auto Receivables Trust, 2023-1A, "A2", 5,68 %, 15/10/2026		4 645	4 639	0,01
LAD Auto Receivables Trust, 2023-2A, "A2", 5,93 %, 15/06/2027		52 779	52 875	0,07
MF1 2020-FL4 Ltd., "A", FLR, 7,146 %, 15/11/2035		44 539	44 537	0,06
MF1 2021-FL5 Ltd., "B", FLR, 6,896 %, 15/07/2036		100 000	98 079	0,13
MF1 2023-FL12 LLC, FLR, "A", 7,401 %, 19/10/2038		100 000	100 170	0,14
OBX Trust, 2024-NQM1, "A1", 5,928 %, 25/11/2063		100 000	100 534	0,14
PFP III 2021-8 Ltd., "A", FLR, 6,452 %, 9/08/2037		28 031	27 789	0,04
PFP III 2021-8 Ltd., "AS", FLR, 6,702 %, 9/08/2037		100 000	97 023	0,13
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "A", FLR, 6,65 %, 25/11/2036		69 166	68 721	0,09
Toyota Lease Owner Trust, 2023-A, "A2", 5,3 %, 20/08/2025		28 145	28 117	0,04
Westlake Automobile Receivables Trust, 2022-3A, "A2", 5,24 %, 15/07/2025		4 244	4 242	0,01
Westlake Automobile Receivables Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 6,196 %, 15/06/2026		6 014	6 019	0,01
World Omni Select Auto Trust 2023-A, "A2B", FLR, 6,196 %, 15/03/2027		31 760	31 795	0,04
			1 140 063	1,57
Industrie automobile				
Clarios Global LP/Clarios U.S. Finance Co., 8,5 %, 15/05/2027		50 000	49 863	0,07
Clarios Global LP/Clarios U.S. Finance Co., 6,75 %, 15/05/2028		28 000	28 372	0,04
Dana, Inc., 5,375 %, 15/11/2027		54 000	52 699	0,07
Dana, Inc., 4,25 %, 1/09/2030		29 000	25 357	0,04
Dornoch Debt Merger Sub, Inc., 6,625 %, 15/10/2029		55 000	49 924	0,07
Hyundai Capital America, 5,3 %, 8/01/2029		50 000	50 713	0,07
Hyundai Capital America, 6,375 %, 8/04/2030		41 000	43 651	0,06
Real Hero Merger Sub 2, Inc., 6,25 %, 1/02/2029		45 000	39 040	0,05
Wabash National Corp., 4,5 %, 15/10/2028		55 000	50 050	0,07
			389 669	0,54
Radio-télévision				
AMC Networks, Inc., 4,75 %, 1/08/2025		15 000	14 453	0,02
Discovery Communications LLC, 4 %, 15/09/2055		29 000	20 418	0,03
Midas OpCo Holdings LLC, 5,625 %, 15/08/2029		71 000	64 969	0,09
Walt Disney Co., 3,35 %, 24/03/2025		18 000	17 699	0,02
Walt Disney Co., 3,5 %, 13/05/2040		83 000	68 885	0,09
Walt Disney Co., 3,8 %, 13/05/2060		52 000	41 065	0,06
WarnerMedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032		41 000	37 540	0,05
WarnerMedia Holdings, Inc., 5,391 %, 15/03/2062		30 000	25 815	0,04
Weibo Corp., 3,375 %, 8/07/2030		200 000	173 488	0,24
			464 332	0,64
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
AG TTMT Escrow Issuer LLC, 8,625 %, 30/09/2027		47 000	48 792	0,07
Aretex Escrow Issuer 2, Inc., 10 %, 15/08/2030		52 000	56 161	0,08
Aretex Escrow Issuer, Inc., 7,5 %, 1/04/2029		45 000	41 887	0,06
Brookfield Finance, Inc., 2,34 %, 30/01/2032		50 000	40 447	0,06
Charles Schwab Corp., 5,643 % jusqu'au 19/05/2028, FLR jusqu'au 19/05/2029		24 000	24 556	0,03
Charles Schwab Corp., 1,95 %, 1/12/2031		24 000	19 281	0,03
Charles Schwab Corp., 6,136 % jusqu'au 24/08/2033, FLR jusqu'au 24/08/2034		29 000	30 649	0,04
LPL Holdings, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		39 000	37 554	0,05
LPL Holdings, Inc., 6,75 %, 17/11/2028		10 000	10 513	0,01
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		37 000	34 100	0,05
LPL Holdings, Inc., 4,375 %, 15/05/2031		91 000	82 718	0,11
NFP Corp., 4,875 %, 15/08/2028		60 000	59 514	0,08
NFP Corp., 6,875 %, 15/08/2028		44 000	44 247	0,06
			530 419	0,73

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Construction				
ABC Supply Co., Inc., 3,875 %, 15/11/2029	USD	32 000	28 513	0,04
Foundation Construction Materials LLC, 6 %, 1/03/2029		66 000	57 997	0,08
GYP Holding III Corp., 4,625 %, 1/05/2029		81 000	75 031	0,10
Interface, Inc., 5,5 %, 1/12/2028		59 000	55 215	0,08
MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Co., 5,5 %, 1/02/2030		56 000	50 960	0,07
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 5,25 %, 15/07/2028		68 000	65 334	0,09
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 9,75 %, 15/07/2028		23 000	23 123	0,03
Patrick Industries, Inc., 7,5 %, 15/10/2027		76 000	76 380	0,10
SRM Concrete, 8,875 %, 15/11/2031		71 000	74 590	0,10
Standard Industries, Inc., 4,75 %, 15/01/2028		37 000	35 388	0,05
Standard Industries, Inc., 4,375 %, 15/07/2030		86 000	78 153	0,11
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030		25 000	23 203	0,03
Vulcan Materials Co., 4,5 %, 15/06/2047		15 000	13 397	0,02
White Cap Buyer LLC, 6,875 %, 15/10/2028		66 000	64 602	0,09
			721 886	0,99
Services aux entreprises				
Entegris Escrow Corp., 5,95 %, 15/06/2030		32 000	31 609	0,04
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049		53 000	46 156	0,06
Iron Mountain, Inc., 4,875 %, 15/09/2027		51 000	49 282	0,07
Iron Mountain, Inc., 5,25 %, 15/03/2028		49 000	47 521	0,07
Mastercard, Inc., 3,85 %, 26/03/2050		47 000	40 187	0,05
Verscend Escrow Corp., 9,75 %, 15/08/2026		83 000	83 331	0,11
Visa, Inc., 2,05 %, 15/04/2030		48 000	42 057	0,06
Visa, Inc., 2,7 %, 15/04/2040		17 000	12 986	0,02
Visa, Inc., 2 %, 15/08/2050		67 000	40 768	0,06
			393 897	0,54
Télévision par câble				
Cable One, Inc., 4 %, 15/11/2030		98 000	78 890	0,11
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 5,125 %, 1/05/2027		36 000	34 723	0,05
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1/03/2030		191 000	169 724	0,23
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,5 %, 15/08/2030		103 000	89 575	0,12
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,25 %, 1/02/2031		53 000	44 814	0,06
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,25 %, 15/01/2034		40 000	31 804	0,04
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 6,384 %, 23/10/2035		29 000	29 239	0,04
Comcast Corp., 4,8 %, 15/05/2033		43 000	43 124	0,06
Comcast Corp., 3,75 %, 1/04/2040		31 000	26 551	0,04
Comcast Corp., 5,35 %, 15/05/2053		43 000	43 828	0,06
Cox Communications, Inc., 5,7 %, 15/06/2033		52 000	53 196	0,07
Cox Communications, Inc., 4,5 %, 30/06/2043		6 000	5 039	0,01
CSC Holdings LLC, 5,375 %, 1/02/2028		200 000	171 817	0,24
DIRECTV Financing LLC, 8,875 %, 1/02/2030		12 000	12 241	0,02
DISH DBS Corp., 7,75 %, 1/07/2026		38 000	22 391	0,03
DISH DBS Corp., 5,25 %, 1/12/2026		65 000	51 188	0,07
DISH DBS Corp., 5,125 %, 1/06/2029		29 000	11 108	0,01
DISH Network Corp., 11,75 %, 15/11/2027		20 000	20 874	0,03
Sirius XM Radio, Inc., 4 %, 15/07/2028		32 000	29 059	0,04
Sirius XM Radio, Inc., 5,5 %, 1/07/2029		102 000	96 900	0,13
Sirius XM Radio, Inc., 3,875 %, 1/09/2031		47 000	39 184	0,05
Videotron Ltd., 5,125 %, 15/04/2027		42 000	41 370	0,06
Videotron Ltd., 3,625 %, 15/06/2029		39 000	35 586	0,05
Virgin Media Finance PLC, 5 %, 15/07/2030		200 000	178 622	0,25
Ziggo Bond Finance B.V., 5,125 %, 28/02/2030		200 000	168 733	0,23
			1 529 580	2,10

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Produits chimiques				
Axalta Coating Systems Ltd., 4,75 %, 15/06/2027	USD	150 000	144 391	0,20
Element Solutions, Inc., 3,875 %, 1/09/2028		56 000	51 159	0,07
LSF11 A5 HoldCo LLC, 6,625 %, 15/10/2029		65 000	55 031	0,07
SCIH Salt Holdings, Inc., 6,625 %, 1/05/2029		61 000	55 410	0,08
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC, 9,5 %, 15/07/2028	EUR	100 000	116 608	0,16
Windsor Holdings III, LLC, 8,5 %, 15/06/2030	USD	82 000	84 419	0,12
			507 018	0,70
Logiciels				
Central Parent LLC/CDK Global II LLC/CDK Financing Co., Inc., 8 %, 15/06/2029		51 000	52 342	0,07
Cisco Systems, Inc., 5,5 %, 15/01/2040		24 000	25 608	0,04
Dun & Bradstreet Corp., 5 %, 15/12/2029		62 000	57 638	0,08
Microsoft Corp., 2,525 %, 1/06/2050		57 000	38 039	0,05
Microsoft Corp., 2,5 %, 15/09/2050		51 000	33 671	0,05
Oracle Corp., 5,55 %, 6/02/2053		91 000	90 432	0,12
			297 730	0,41
Logiciels - Systèmes				
Apple, Inc., 1,7 %, 5/08/2031		72 000	59 784	0,08
Apple, Inc., 2,65 %, 11/05/2050		88 000	59 449	0,08
Fair Isaac Corp., 5,25 %, 15/05/2026		106 000	104 675	0,14
Sabre GBLB, Inc., 8,625 %, 1/06/2027		29 000	27 115	0,04
Sabre GBLB, Inc., 11,25 %, 15/12/2027		28 000	28 035	0,04
SS&C Technologies Holdings, Inc., 5,5 %, 30/09/2027		108 000	106 017	0,15
Virtusa Corp., 7,125 %, 15/12/2028		33 000	28 938	0,04
			414 013	0,57
Conglomérats				
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 30/06/2028		33 000	30 981	0,04
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 15/04/2029		125 000	115 790	0,16
Chart Industries, Inc., 9,5 %, 1/01/2031		34 000	36 262	0,05
Emerald Debt Merger, 6,625 %, 15/12/2030		74 000	74 745	0,10
Gates Global LLC, 6,25 %, 15/01/2026		45 000	45 004	0,06
Griffon Corp., 5,75 %, 1/03/2028		65 000	63 700	0,09
Madison IAQ LLC, 5,875 %, 30/06/2029		57 000	50 650	0,07
nVent Finance S.à r.l., 5,65 %, 15/05/2033		41 000	42 082	0,06
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		36 000	36 527	0,05
Regal Rexnord Corp., 6,3 %, 15/02/2030		77 000	79 147	0,11
TriMas Corp., 4,125 %, 15/04/2029		118 000	105 058	0,15
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,7 %, 15/09/2028		54 000	53 485	0,07
			733 431	1,01
Construction				
Mattamy Group Corp., 5,25 %, 15/12/2027		30 000	28 946	0,04
Mattamy Group Corp., 4,625 %, 1/03/2030		44 000	40 115	0,05
Weekley Homes LLC/Weekley Finance Corp., 4,875 %, 15/09/2028		61 000	56 853	0,08
			125 914	0,17
Biens de consommation				
Energizer Holdings, Inc., 4,375 %, 31/03/2029		97 000	87 805	0,12
HFC Prestige Products, Inc./HFC Prestige International US LLC, 6,625 %, 15/07/2030		72 000	73 337	0,10
Kenvue, Inc., 5 %, 22/03/2030		50 000	51 228	0,07
Kenvue, Inc., 5,1 %, 22/03/2043		33 000	33 823	0,05
Kenvue, Inc., 5,05 %, 22/03/2053		31 000	31 261	0,04
Mattel, Inc., 3,75 %, 1/04/2029		68 000	62 147	0,09
Prestige Consumer Healthcare, Inc., 5,125 %, 15/01/2028		70 000	68 517	0,09
Prestige Consumer Healthcare, Inc., 3,75 %, 1/04/2031		34 000	29 484	0,04
			437 602	0,60
Services de consommation				
Allied Universal Holdco LLC, 9,75 %, 15/07/2027		107 000	104 624	0,14

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services de consommation, suite				
Arches Buyer, Inc., 6,125 %, 1/12/2028	USD	59 000	50 965	0,07
Booking Holdings, Inc., 3,55 %, 15/03/2028		54 000	52 157	0,07
Booking Holdings, Inc., 4,625 %, 13/04/2030		13 000	13 035	0,02
CBRE Group, Inc., 5,95 %, 15/08/2034		74 000	76 560	0,11
Cushman & Wakefield PLC, 6,75 %, 15/05/2028		51 000	50 302	0,07
GoDaddy, Inc., 3,5 %, 1/03/2029		106 000	95 972	0,13
GW B-CR Security Corp., 9,5 %, 1/11/2027		61 000	61 368	0,08
Match Group Holdings II LLC, 5 %, 15/12/2027		52 000	50 309	0,07
Match Group Holdings II LLC, 4,625 %, 1/06/2028		90 000	84 719	0,12
Match Group Holdings II LLC, 4,125 %, 1/08/2030		13 000	11 697	0,02
Match Group Holdings II LLC, 3,625 %, 1/10/2031		5 000	4 275	0,01
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,75 %, 15/01/2029		43 000	31 939	0,04
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,25 %, 15/04/2030		50 000	35 154	0,05
TriNet Group, Inc., 3,5 %, 1/03/2029		98 000	86 490	0,12
WASH Multi-Family Acquisition, Inc., 5,75 %, 15/04/2026		55 000	52 873	0,07
			862 439	1,19
Conteneurs				
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 3,25 %, 1/09/2028		200 000	174 793	0,24
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,875 %, 15/11/2029		200 000	176 262	0,24
Crown Americas LLC, 5,25 %, 1/04/2030		32 000	30 920	0,04
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. V, 4,25 %, 30/09/2026		74 000	71 323	0,10
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. VI, 4,75 %, 1/02/2026		30 000	29 375	0,04
Crown European Holdings S.A., 4,75 %, 15/03/2029	EUR	100 000	109 502	0,15
			592 175	0,81
Électronique				
Entegris, Inc., 4,375 %, 15/04/2028	USD	38 000	35 837	0,05
Entegris, Inc., 3,625 %, 1/05/2029		42 000	37 884	0,05
Intel Corp., 5,2 %, 10/02/2033		43 000	44 265	0,06
Intel Corp., 5,7 %, 10/02/2053		102 000	107 299	0,15
Lam Research Corp., 1,9 %, 15/06/2030		13 000	11 132	0,01
Lam Research Corp., 4,875 %, 15/03/2049		54 000	52 568	0,07
Sensata Technologies B.V., 5 %, 1/10/2025		71 000	70 679	0,10
Sensata Technologies, Inc., 4,375 %, 15/02/2030		55 000	50 679	0,07
			410 343	0,56
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Bank Gospodarstwa Krajowego (République de Pologne), 5,375 %, 22/05/2033		200 000	200 666	0,28
Chile Electricity Lux MPC S.à r.l., 6,01 %, 20/01/2033		200 000	204 304	0,28
Ecopetrol S.A. (République de Colombie), 8,375 %, 19/01/2036		21 000	21 267	0,03
Empresa Nacional del Petroleo (République du Chili), 5,25 %, 6/11/2029		200 000	193 284	0,27
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 7,125 %, 11/02/2025		200 000	198 988	0,27
First Abu Dhabi Bank PJSC, 6,32 % jusqu'au 4/04/2031, FLR jusqu'au 4/04/2034		200 000	205 375	0,28
Ipoteka Bank (République d'Ouzbékistan), 5,5 %, 19/11/2025		200 000	188 480	0,26
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 6,375 %, 24/10/2048		200 000	184 018	0,25
Magyar Export-Import Bank PLC (République de Hongrie), 6 %, 16/05/2029	EUR	100 000	113 776	0,16
National Bank of Uzbekistan, 4,85 %, 21/10/2025	USD	200 000	188 980	0,26
Office Cherifien des Phosphates S.A. (Royaume du Maroc), 5,125 %, 23/06/2051		200 000	144 084	0,20
Petroleos Mexicanos, 6,7 %, 16/02/2032		71 000	57 970	0,08
Petroleos Mexicanos, 10 %, 7/02/2033		75 000	74 171	0,10
Petroleos Mexicanos, 6,75 %, 21/09/2047		91 000	58 045	0,08
Petroleos Mexicanos, 7,69 %, 23/01/2050		132 000	92 282	0,13
Petroleos Mexicanos, 6,95 %, 28/01/2060		57 000	36 550	0,05
QNB Finance Ltd. (État du Qatar), 2,75 %, 12/02/2027		200 000	186 806	0,26
Saudi Arabian Oil Co., 3,5 %, 24/11/2070		200 000	127 500	0,17

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair		Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations quasi souveraines des marchés émergents, suite				
State Oil Company of the Azerbaijan Republic, 6,95 %, 18/03/2030	USD	200 000	206 000	0,28
			2 682 546	3,69
Obligations souveraines des marchés émergents				
République arabe d'Égypte, 7,625 %, 29/05/2032		200 000	135 451	0,19
République tchèque, 5 %, 30/09/2030	CZK	1 940 000	90 866	0,13
République tchèque, 2 %, 13/10/2033		1 930 000	71 741	0,10
République dominicaine, 5,3 %, 21/01/2041	USD	150 000	126 000	0,17
République dominicaine, 6,4 %, 5/06/2049		256 000	235 797	0,32
République fédérale du Nigeria, 7,875 %, 16/02/2032		200 000	173 384	0,24
République fédérale du Nigeria, 8,25 %, 28/09/2051		200 000	158 032	0,22
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2027	BRL	521 000	105 456	0,15
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2029		417 000	83 385	0,11
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2031		241 000	47 505	0,07
Gouvernement d'Ukraine, 7,375 %, 25/09/2034 (p)	USD	350 000	79 100	0,11
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031	UYU	1 835 000	44 144	0,06
République orientale d'Uruguay, 9,75 %, 20/07/2033		2 828 000	74 453	0,10
République orientale d'Uruguay, 4,975 %, 20/04/2055	USD	24 000	22 628	0,03
République d'Angola, 9,375 %, 8/05/2048		200 000	160 412	0,22
République argentine, 3,625 %, 9/07/2035		227 000	75 747	0,10
République argentine, 4,25 %, 9/01/2038		119 000	45 807	0,06
République argentine, 3,5 %, 9/07/2041		248 000	82 607	0,11
République de Bulgarie, 4,875 %, 13/05/2036	EUR	165 000	189 375	0,26
République du Costa Rica, 7,3 %, 13/11/2054	USD	200 000	209 280	0,29
République de Côte d'Ivoire, 4,875 %, 30/01/2032	EUR	100 000	90 509	0,12
République de Côte d'Ivoire, 7,625 %, 30/01/2033	USD	200 000	198 100	0,27
République de Côte d'Ivoire, 6,875 %, 17/10/2040	EUR	100 000	90 087	0,12
République d'Équateur, 3,5 %, 31/07/2035	USD	49 000	19 915	0,03
République d'Équateur, 2,5 %, 31/07/2040		137 000	49 834	0,07
République du Salvador, 8,25 %, 10/04/2032		46 000	39 330	0,05
République du Salvador, 7,65 %, 15/06/2035		22 000	17 182	0,02
République de Corée, 3,25 %, 10/03/2028	KRW	39 050 000	29 262	0,04
République de Roumanie, 6,625 %, 17/02/2028	USD	122 000	126 288	0,17
République de Roumanie, 5,875 %, 30/01/2029		18 000	18 214	0,03
République de Roumanie, 1,75 %, 13/07/2030	EUR	53 000	46 837	0,06
République de Roumanie, 2 %, 14/04/2033		30 000	24 604	0,03
République de Roumanie, 6,375 %, 30/01/2034	USD	18 000	18 440	0,03
République de Serbie, 6,25 %, 26/05/2028		200 000	203 686	0,28
République du Sri Lanka, 7,55 %, 28/03/2030 (d)		200 000	100 962	0,14
République turque, 8,509 %, 14/01/2029		200 000	207 208	0,29
République turque, 6 %, 14/01/2041		200 000	159 226	0,22
République turque, 5,75 %, 11/05/2047		200 000	145 592	0,20
République du Venezuela, 7 %, 31/03/2038 (d)		201 000	29 282	0,04
Sultanat d'Oman, 6,75 %, 17/01/2048		200 000	200 901	0,28
Sultanat d'Oman, 7 %, 25/01/2051		200 000	206 521	0,28
États-Unis du Mexique, 5,75 %, 5/03/2026	MXN	500 000	26 784	0,04
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 3/06/2027		1 000 000	54 992	0,08
États-Unis du Mexique, 8,5 %, 31/05/2029		1 000 000	56 613	0,08
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031		1 200 000	64 446	0,09
États-Unis du Mexique, 6 %, 7/05/2036	USD	200 000	203 693	0,28
États-Unis du Mexique, 6,338 %, 4/05/2053		200 000	199 361	0,27
			4 839 039	6,65
Énergie - Sociétés indépendantes				
3R Lux S.à r.l., 9,75 %, 5/02/2031		200 000	199 400	0,27
Callon Petroleum Co., 8 %, 1/08/2028		50 000	51 714	0,07

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Énergie - Sociétés indépendantes, suite				
Callon Petroleum Co., 7,5 %, 15/06/2030	USD	16 000	16 855	0,02
Civitas Resources, Inc., 8,375 %, 1/07/2028		51 000	53 637	0,07
Civitas Resources, Inc., 8,625 %, 1/11/2030		15 000	15 998	0,02
Civitas Resources, Inc., 8,75 %, 1/07/2031		32 000	34 019	0,05
Comstock Resources, Inc., 6,75 %, 1/03/2029		85 000	78 051	0,11
CrownRock LP/CrownRock Finance, Inc., F, 5 %, 1/05/2029		59 000	58 267	0,08
EQT Corp., 3,625 %, 15/05/2031		30 000	26 729	0,04
Matador Resources Co., 6,875 %, 15/04/2028		61 000	62 465	0,09
Moss Creek Resources Holdings, Inc., 7,5 %, 15/01/2026		49 000	48 818	0,07
Occidental Petroleum Corp., 6,125 %, 1/01/2031		24 000	24 913	0,03
Occidental Petroleum Corp., 4,4 %, 15/04/2046		47 000	38 539	0,05
Permian Resources Operating LLC, 7,75 %, 15/02/2026		10 000	10 160	0,01
Permian Resources Operating LLC, 5,875 %, 1/07/2029		81 000	79 225	0,11
Permian Resources Operating LLC, 7 %, 15/01/2032		32 000	33 037	0,05
Pioneer Natural Resources Co., 1,9 %, 15/08/2030		47 000	40 044	0,06
Pioneer Natural Resources Co., 2,15 %, 15/01/2031		24 000	20 445	0,03
Sitio Royalties Operating Partnership, LP, 7,875 %, 1/11/2028		60 000	61 529	0,08
SM Energy Co., 6,5 %, 15/07/2028		45 000	45 000	0,06
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 3,25 %, 15/08/2030		200 000	164 610	0,23
			1 163 455	1,60
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets America, Inc., 1,749 %, 10/08/2030		29 000	24 375	0,03
BP Capital Markets America, Inc., 4,812 %, 13/02/2033		32 000	31 968	0,05
BP Capital Markets America, Inc., 3,001 %, 17/03/2052		41 000	28 326	0,04
Citgo Petroleum Corp., 8,375 %, 15/01/2029		51 000	52 987	0,07
			137 656	0,19
Divertissement				
Carnival Corp. PLC, 7,625 %, 1/03/2026		53 000	53 836	0,07
Carnival Corp. PLC, 5,75 %, 1/03/2027		91 000	89 653	0,12
Carnival Corp. PLC, 4 %, 1/08/2028		32 000	29 600	0,04
Carnival Corp. PLC, 6 %, 1/05/2029		32 000	30 995	0,04
Merlin Entertainments, 7,375 %, 15/02/2031		200 000	200 272	0,28
NCL Corp. Ltd., 5,875 %, 15/03/2026		50 000	48 754	0,07
NCL Corp. Ltd., 7,75 %, 15/02/2029		30 000	30 291	0,04
Royal Caribbean Cruises Ltd., 5,375 %, 15/07/2027		45 000	44 281	0,06
Royal Caribbean Cruises Ltd., 5,5 %, 1/04/2028		67 000	66 147	0,09
SeaWorld Parks & Entertainment, 5,25 %, 15/08/2029		42 000	39 115	0,05
Viking Cruises Ltd. Co., 5,875 %, 15/09/2027		21 000	20 240	0,03
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd., 5,625 %, 15/02/2029		35 000	34 081	0,05
VOC Escrow Ltd., 5 %, 15/02/2028		34 000	32 467	0,05
			719 732	0,99
Établissements financiers				
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21/02/2028		49 000	43 857	0,06
Castlelake Aviation Finance Designated Activity Co., 5 %, 15/04/2027		13 000	12 340	0,02
Credit Acceptance Corp., 6,625 %, 15/03/2026		9 000	8 998	0,01
Credit Acceptance Corp., 9,25 %, 15/12/2028		51 000	53 550	0,07
Freedom Mortgage Corp., 7,625 %, 1/05/2026		40 000	39 837	0,05
Freedom Mortgage Holdings LLC, 9,25 %, 1/02/2029		13 000	13 164	0,02
FTAI Aviation Ltd., 5,5 %, 1/05/2028		29 000	28 100	0,04
FTAI Aviation Ltd., 7,875 %, 1/12/2030		34 000	35 863	0,05
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		131 352	126 591	0,17
Howard Hughes Corp., 4,125 %, 1/02/2029		74 000	66 737	0,09
Jefferson Capital Holdings LLC, 9,5 %, 15/02/2029		45 000	45 323	0,06
Macquarie AirFinance Holdings Ltd., 8,375 %, 1/05/2028		70 000	73 532	0,10

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS

au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Établissements financiers, suite				
Macquarie AirFinance Holdings Ltd., 8,125 %, 30/03/2029	USD	11 000	11 413	0,02
Nationstar Mortgage Holdings, Inc., 6 %, 15/01/2027		87 000	85 305	0,12
OneMain Finance Corp., 6,875 %, 15/03/2025		53 000	53 199	0,07
OneMain Finance Corp., 7,125 %, 15/03/2026		76 000	77 036	0,11
OneMain Finance Corp., 5,375 %, 15/11/2029		35 000	32 384	0,04
PRA Group, Inc., 8,375 %, 1/02/2028		20 000	19 051	0,03
Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc., 3,625 %, 1/03/2029		46 000	40 887	0,06
Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc., 3,875 %, 1/03/2031		15 000	13 107	0,02
Shriram Transport Finance Co. Ltd., 4,4 %, 13/03/2024		200 000	199 180	0,27
SLM Corp., 3,125 %, 2/11/2026		31 000	29 026	0,04
			1 108 480	1,52
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 5,55 %, 23/01/2049		83 000	87 838	0,12
B&G Foods, Inc., 5,25 %, 15/09/2027		25 000	22 549	0,03
B&G Foods, Inc., 8 %, 15/09/2028		31 000	32 314	0,04
Bacardi Ltd., 5,15 %, 15/05/2038		100 000	96 838	0,13
Bimbo Bakeries USA, Inc., 5,375 %, 9/01/2036		200 000	201 672	0,28
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029		71 000	66 323	0,09
Chobani LLC/Chobani Finance Corp., 7,625 %, 1/07/2029		5 000	5 062	0,01
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		23 000	19 190	0,03
Constellation Brands, Inc., 4,1 %, 15/02/2048		79 000	65 878	0,09
Diageo Capital PLC, 5,625 %, 5/10/2033		200 000	213 576	0,29
Fiesta Purchaser, Inc., 7,875 %, 1/03/2031		39 000	39 455	0,05
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3 %, 2/02/2029		35 000	30 954	0,04
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3,75 %, 1/12/2031		18 000	15 430	0,02
JM Smucker Co., 6,5 %, 15/11/2053		26 000	29 377	0,04
Kraft Heinz Foods Co., 4,875 %, 1/10/2049		26 000	24 157	0,03
Kraft Heinz Foods Co., 5,5 %, 1/06/2050		49 000	49 646	0,07
Mars, Inc., 4,55 %, 20/04/2028		72 000	72 098	0,10
Mars, Inc., 4,75 %, 20/04/2033		58 000	57 879	0,08
Performance Food Group Co., 5,5 %, 15/10/2027		64 000	62 419	0,09
Post Holdings, Inc., 5,625 %, 15/01/2028		52 000	51 173	0,07
Post Holdings, Inc., 4,625 %, 15/04/2030		87 000	80 009	0,11
Primo Water Holding, Inc., 4,375 %, 30/04/2029		96 000	87 399	0,12
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 4,805 %, 27/04/2052		200 000	159 000	0,22
SYSCO Corp., 2,45 %, 14/12/2031		110 000	93 366	0,13
SYSCO Corp., 4,45 %, 15/03/2048		18 000	15 639	0,02
TreeHouse Foods, Inc., 4 %, 1/09/2028		56 000	49 952	0,07
U.S. Foods Holding Corp., 4,75 %, 15/02/2029		73 000	69 260	0,10
United Natural Foods, Inc., 6,75 %, 15/10/2028		33 000	27 720	0,04
			1 826 173	2,51
Jeux et hôtellerie				
Caesars Entertainment, Inc., 4,625 %, 15/10/2029		24 000	21 939	0,03
Caesars Entertainment, Inc., 7 %, 15/02/2030		55 000	56 521	0,08
Caesars Entertainment, Inc., 6,5 %, 15/02/2032		15 000	15 166	0,02
Caesars Resort Collection LLC/CRC Finco, Inc., 8,125 %, 1/07/2027		58 000	59 522	0,08
CCM Merger, Inc., 6,375 %, 1/05/2026		62 000	61 230	0,08
CDI Escrow Issuer, Inc., 5,75 %, 1/04/2030		71 000	68 688	0,10
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031		68 000	59 044	0,08
Marriott International, Inc., 3,5 %, 15/10/2032		28 000	24 969	0,03
Penn National Gaming, Inc., 4,125 %, 1/07/2029		66 000	56 429	0,08
Sands China Ltd., 3,25 %, 8/08/2031		200 000	166 142	0,23
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc., 4,25 %, 1/12/2026		22 000	21 181	0,03
Wyndham Hotels & Resorts, Inc., 4,375 %, 15/08/2028		70 000	65 356	0,09

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Jeux et hôtellerie, suite				
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp., 5,125 %, 1/10/2029	USD	70 000	66 129	0,09
			742 316	1,02
Industrie				
Api Escrow Corp., 4,75 %, 15/10/2029		92 000	86 141	0,12
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,516 %, 1/10/2025		12 000	11 573	0,01
Trustees of the University of Pennsylvania, 2,396 %, 1/10/2050		82 000	51 365	0,07
Williams Scotsman International, Inc., 4,625 %, 15/08/2028		82 000	77 619	0,11
			226 698	0,31
Assurances				
Corebridge Financial, Inc., 3,9 %, 5/04/2032		52 000	46 842	0,06
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042		57 000	48 787	0,07
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		40 000	41 066	0,06
			136 695	0,19
Assurances - Santé				
Humana, Inc., 4,95 %, 1/10/2044		26 000	24 205	0,03
Humana, Inc., 5,5 %, 15/03/2053		5 000	5 008	0,01
UnitedHealth Group, Inc., 5,3 %, 15/02/2030		38 000	39 416	0,05
UnitedHealth Group, Inc., 2,3 %, 15/05/2031		64 000	54 966	0,08
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035		29 000	29 003	0,04
UnitedHealth Group, Inc., 5,875 %, 15/02/2053		31 000	34 405	0,05
			187 003	0,26
Assurances IARD				
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc., 8,25 %, 1/02/2029		28 000	28 072	0,04
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc., 4,25 %, 15/02/2029		17 000	15 244	0,02
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc., 6 %, 1/08/2029		31 000	28 438	0,04
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6,75 %, 15/10/2027		45 000	43 934	0,06
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 5,875 %, 1/11/2029		79 000	74 815	0,10
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 7 %, 15/01/2031		39 000	39 413	0,05
American International Group, Inc., 5,125 %, 27/03/2033		37 000	37 447	0,05
AmWINS Group Benefits, Inc., 4,875 %, 30/06/2029		61 000	56 934	0,08
Arthur J. Gallagher & Co., 6,5 %, 15/02/2034		35 000	38 394	0,05
Arthur J. Gallagher & Co., 6,75 %, 15/02/2054		34 000	39 301	0,05
AssuredPartners, Inc., 5,625 %, 15/01/2029		50 000	47 221	0,07
Fairfax Financial Holdings Ltd., 3,375 %, 3/03/2031		34 000	29 862	0,04
Fairfax Financial Holdings Ltd., 5,625 %, 16/08/2032		12 000	12 015	0,02
GTCR (AP) Finance, Inc., 8 %, 15/05/2027		42 000	42 079	0,06
Hub International Ltd., 5,625 %, 1/12/2029		52 000	49 068	0,07
Hub International Ltd., 7,25 %, 15/06/2030		45 000	46 290	0,06
Hub International Ltd., 7,375 %, 31/01/2032		30 000	30 723	0,04
RenaissanceRe Holdings Ltd., 5,75 %, 5/06/2033		47 000	47 678	0,07
			706 928	0,97
Obligations souveraines du marché international				
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		200 000	194 000	0,27
Gouvernement des Bermudes, 3,375 %, 20/08/2050		200 000	134 500	0,18
			328 500	0,45
Machines et outils				
CNH Industrial Capital LLC, 5,5 %, 12/01/2029		45 000	46 278	0,06
CNH Industrial N.V., 3,85 %, 15/11/2027		65 000	62 863	0,09
Husky Injection Molding Systems Ltd., 9 %, 15/02/2029		5 000	5 000	0,01
Ritchie Bros Holdings, Inc., 7,75 %, 15/03/2031		87 000	91 682	0,13
Terex Corp., 5 %, 15/05/2029		66 000	62 370	0,08
			268 193	0,37
Grandes banques				
Bank of America Corp., 3,366 % jusqu'au 23/01/2025, FLR jusqu'au 23/01/2026		69 000	67 576	0,09
Bank of America Corp., 3,419 % jusqu'au 20/12/2027, FLR jusqu'au 20/12/2028		77 000	72 738	0,10

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
Bank of America Corp., 5,819 % jusqu'au 15/09/2028, FLR jusqu'au 15/09/2029	USD	46 000	47 560	0,07
Bank of America Corp., 2,687 % jusqu'au 22/04/2031, FLR jusqu'au 22/04/2032		45 000	38 201	0,05
Bank of America Corp., 5,872 % jusqu'au 15/09/2033, FLR jusqu'au 15/09/2034		61 000	63 876	0,09
Bank of New York Mellon Corp., 5,802 % jusqu'au 25/10/2027, FLR jusqu'au 25/10/2028		19 000	19 703	0,03
Capital One Financial Corp., 6,312 % jusqu'au 8/06/2028, FLR jusqu'au 8/06/2029		23 000	23 711	0,03
Capital One Financial Corp., 6,377 % jusqu'au 8/06/2033, FLR jusqu'au 8/06/2034		18 000	18 703	0,03
Credit Agricole S.A., 1,247 % jusqu'au 26/01/2026, FLR jusqu'au 26/01/2027		250 000	231 396	0,32
Goldman Sachs Group, Inc., 2,64 % jusqu'au 24/02/2027, FLR jusqu'au 24/02/2028		38 000	35 404	0,05
Huntington Bancshares, Inc., 6,208 % jusqu'au 21/08/2028, FLR jusqu'au 21/08/2029		36 000	37 208	0,05
JPMorgan Chase & Co., 6,07 % jusqu'au 22/10/2026, FLR jusqu'au 22/10/2027		57 000	58 714	0,08
JPMorgan Chase & Co., 3,782 % jusqu'au 1/02/2027, FLR jusqu'au 1/02/2028		31 000	30 013	0,04
JPMorgan Chase & Co., 2,545 % jusqu'au 8/11/2031, FLR jusqu'au 8/11/2032		217 000	181 970	0,25
JPMorgan Chase & Co., 5,336 % jusqu'au 23/01/2034, FLR jusqu'au 23/01/2035		21 000	21 341	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,494 % jusqu'au 13/10/2031, FLR jusqu'au 13/10/2032		200 000	167 441	0,23
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		127 000	121 873	0,17
Morgan Stanley, 5,449 % jusqu'au 20/07/2028, FLR jusqu'au 20/07/2029		23 000	23 409	0,03
Morgan Stanley, 3,622 % jusqu'au 1/04/2030, FLR jusqu'au 1/04/2031		13 000	11 995	0,02
Morgan Stanley, 5,424 % jusqu'au 21/07/2033, FLR jusqu'au 21/07/2034		41 000	41 531	0,06
Nordea Bank Abp, 1,5 %, 30/09/2026		200 000	183 001	0,25
PNC Financial Services Group, Inc., 5,3 % jusqu'au 21/01/2027, FLR jusqu'au 21/01/2028		25 000	25 221	0,03
PNC Financial Services Group, Inc., 5,676 % jusqu'au 22/01/2034, FLR jusqu'au 22/01/2035		30 000	30 786	0,04
Royal Bank of Canada, 2,3 %, 3/11/2031		66 000	55 242	0,08
Royal Bank of Canada, 5 %, 1/02/2033		18 000	18 003	0,02
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5,65 %, 9/03/2026		200 000	202 845	0,28
Toronto-Dominion Bank, 4,108 %, 8/06/2027		29 000	28 457	0,04
Toronto-Dominion Bank, 4,693 %, 15/09/2027		54 000	53 909	0,07
Toronto-Dominion Bank, 2 %, 10/09/2031		29 000	24 001	0,03
UBS Group AG, 9,25 % jusqu'au 13/11/2028, FLR jusqu'au 13/05/2172		200 000	213 938	0,29
Wells Fargo & Co., 4,54 % jusqu'au 15/08/2025, FLR jusqu'au 15/08/2026		41 000	40 587	0,06
Wells Fargo & Co., 5,574 % jusqu'au 25/07/2028, FLR jusqu'au 25/07/2029		37 000	37 815	0,05
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033		23 000	20 188	0,03
			2 248 356	3,09
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance Corp., 2,75 %, 23/09/2026		200 000	189 216	0,26
Avantor Funding, Inc., 4,625 %, 15/07/2028		91 000	86 636	0,12
Bausch & Lomb Escrow Corp., 8,375 %, 1/10/2028		53 000	54 991	0,08
Becton, Dickinson and Co., 2,823 %, 20/05/2030		22 000	19 659	0,03
Becton, Dickinson and Co., 4,298 %, 22/08/2032		27 000	26 010	0,04
Charles River Laboratories International, Inc., 3,75 %, 15/03/2029		105 000	95 495	0,13
CHS/Community Health Systems, Inc., 8 %, 15/12/2027		35 000	34 467	0,05
CHS/Community Health Systems, Inc., 6,125 %, 1/04/2030		79 000	51 419	0,07
CHS/Community Health Systems, Inc., 5,25 %, 15/05/2030		75 000	62 094	0,09
CVS Health Corp., 5 %, 20/02/2026		24 000	24 079	0,03
CVS Health Corp., 5,625 %, 21/02/2053		30 000	29 871	0,04
Encompass Health Corp., 5,75 %, 15/09/2025		25 000	24 841	0,03
Encompass Health Corp., 4,75 %, 1/02/2030		67 000	62 837	0,09
Encompass Health Corp., 4,625 %, 1/04/2031		10 000	9 187	0,01
HCA, Inc., 5,2 %, 1/06/2028		32 000	32 322	0,04
HCA, Inc., 5,875 %, 1/02/2029		12 000	12 377	0,02
IQVIA, Inc., 6,25 %, 1/02/2029		35 000	36 425	0,05
Legacy LifePoint Health LLC, 4,375 %, 15/02/2027		49 000	45 635	0,06
Marin General Hospital, 7,242 %, 1/08/2045		27 000	28 700	0,04
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,325 %, 15/11/2028		43 000	43 860	0,06
Star Parent, Inc., 9 %, 1/10/2030		44 000	46 266	0,06

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Technologies et services médicaux et de santé, suite				
Tenet Healthcare Corp., 6,125 %, 1/10/2028	USD	40 000	39 853	0,05
Tenet Healthcare Corp., 4,375 %, 15/01/2030		34 000	31 461	0,04
Tenet Healthcare Corp., 6,125 %, 15/06/2030		63 000	62 977	0,09
Tenet Healthcare Corp., 6,75 %, 15/05/2031		28 000	28 639	0,04
Thermo Fisher Scientific, Inc., 4,977 %, 10/08/2030		76 000	77 692	0,11
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2 %, 15/10/2031		27 000	22 571	0,03
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2,8 %, 15/10/2041		9 000	6 742	0,01
U.S. Acute Care Solutions LLC, 6,375 %, 1/03/2026		55 000	48 060	0,07
			1 334 382	1,84
Équipements médicaux				
Danaher Corp., 2,6 %, 1/10/2050		50 000	32 729	0,05
Embecta Corp., 5 %, 15/02/2030		65 000	53 188	0,07
Garden SpinCo Corp., 8,625 %, 20/07/2030		56 000	59 920	0,08
Medline Borrower LP, 5,25 %, 1/10/2029		77 000	71 796	0,10
Teleflex, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		33 000	32 014	0,04
			249 647	0,34
Métaux et exploitation minière				
Baffinland Iron Mines Corp./Baffinland Iron Mines LP, 8,75 %, 15/07/2026		57 000	52 155	0,07
FMG Resources Ltd., 4,375 %, 1/04/2031		143 000	128 699	0,18
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031		59 000	50 996	0,07
GrafTech Finance, Inc., 4,625 %, 15/12/2028		79 000	52 308	0,07
GrafTech Finance, Inc., 9,875 %, 15/12/2028		15 000	11 210	0,02
Kaiser Aluminum Corp., 4,625 %, 1/03/2028		72 000	66 348	0,09
Kaiser Aluminum Corp., 4,5 %, 1/06/2031		38 000	32 444	0,04
Novelis Corp., 3,25 %, 15/11/2026		44 000	41 198	0,06
Novelis Corp., 4,75 %, 30/01/2030		67 000	62 142	0,09
Novelis Corp., 3,875 %, 15/08/2031		32 000	27 755	0,04
Petra Diamonds US\$ Treasury PLC, 9,75 %, 8/03/2026		36 826	29 829	0,04
Petra Diamonds US\$ Treasury PLC, 9,75 %, 8/03/2026		125 208	101 419	0,14
Samarco Mineracao S.A., 9,05 % PIK jusqu'au 30/03/2024, 9 % PIK jusqu'au 30/12/2025, (4 % liquidités + 5 % PIK) jusqu'au 30/12/2026, (5,5 % liquidités + 3,5 % PIK) jusqu'au 30/12/2027, 9,25 % liquidités jusqu'au 30/12/2029, 9,5 % Liquidités au 30/06/2031 (p)		20 000	16 631	0,02
Taseko Mines Ltd., 7 %, 15/02/2026		55 000	54 037	0,07
			727 171	1,00
Secteur intermédiaire				
Columbia Pipelines Holdings Co. LLC, 6,055 %, 15/08/2026		10 000	10 225	0,01
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 6,497 %, 15/08/2043		2 000	2 186	0,00
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 6,544 %, 15/11/2053		58 000	63 693	0,09
DT Midstream, Inc., 4,125 %, 15/06/2029		57 000	52 369	0,07
DT Midstream, Inc., 4,375 %, 15/06/2031		86 000	77 036	0,11
Enbridge, Inc., 5,969 %, 8/03/2026		28 000	27 999	0,04
Enbridge, Inc., 5,7 %, 8/03/2033		25 000	25 791	0,03
Energy Transfer LP, 4 %, 1/10/2027		28 000	27 044	0,04
Energy Transfer LP, 5,95 %, 15/05/2054		33 000	33 094	0,05
Enterprise Products Operating LLC, 4,85 %, 31/01/2034		71 000	71 043	0,10
EQM Midstream Partners LP, 5,5 %, 15/07/2028		113 000	111 971	0,15
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 1,75 %, 30/09/2027		129 320	121 160	0,17
Kinetik Holdings, Inc., 5,875 %, 15/06/2030		71 000	69 740	0,10
NuStar Logistics, LP, 6,375 %, 1/10/2030		55 000	55 275	0,08
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030		200 000	164 643	0,23
Plains All American Pipeline LP, 4,65 %, 15/10/2025		19 000	18 857	0,03
Plains All American Pipeline LP, 3,55 %, 15/12/2029		59 000	54 295	0,07
Tallgrass Energy Partners LP, 5,5 %, 15/01/2028		96 000	92 416	0,13
Tallgrass Energy Partners LP, 7,375 %, 15/02/2029		29 000	28 928	0,04
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		46 000	40 117	0,05

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Secteur intermédiaire, suite				
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3,875 %, 15/08/2029	USD	60 000	53 626	0,07
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 6,25 %, 15/01/2030		29 000	29 023	0,04
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15/08/2031		60 000	53 059	0,07
Venture Global LNG, Inc., 8,125 %, 1/06/2028		53 000	53 567	0,07
Venture Global LNG, Inc., 9,5 %, 1/02/2029		57 000	60 536	0,08
Venture Global LNG, Inc., 8,375 %, 1/06/2031		59 000	59 580	0,08
			1 457 273	2,00
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 3 %, 1/11/2028–1/09/2046		391 838	367 106	0,50
Fannie Mae, 2,5 %, 1/11/2031–1/10/2046		30 378	27 109	0,04
Fannie Mae, 7 %, 25/09/2032		5 072	5 355	0,01
Fannie Mae, 2 %, 25/01/2033–25/05/2044		21 958	20 535	0,03
Fannie Mae, 3 %, 25/02/2033 (i)		24 890	2 072	0,00
Fannie Mae, 3,556 %, 25/06/2033		18 232	17 680	0,02
Fannie Mae, 5,909 %, 25/04/2034		2 154	2 152	0,00
Fannie Mae, 5,749 %, 25/01/2036		1 888	1 885	0,00
Fannie Mae, 5,5 %, 1/08/2037–1/05/2044		143 712	147 802	0,20
Fannie Mae, 5,759 %, 25/10/2039–25/12/2045		17 020	16 637	0,03
Fannie Mae, 3,5 %, 25/04/2040–25/06/2048		182 817	169 589	0,23
Fannie Mae, 4 %, 1/09/2040–1/07/2043		123 451	118 776	0,17
Fannie Mae, 5 %, 1/10/2040–25/03/2042		112 996	113 905	0,15
Fannie Mae, 4,5 %, 1/02/2041–1/11/2042		73 115	72 759	0,10
Fannie Mae, 1 %, 25/03/2041		11 845	10 177	0,01
Fannie Mae, 5,809 %, 25/03/2041–25/12/2042		3 929	3 892	0,00
Fannie Mae, 2,25 %, 25/04/2041–25/07/2043		28 129	25 763	0,04
Fannie Mae, 5,959 %, 25/07/2041		5 014	4 943	0,01
Fannie Mae, 1,75 %, 25/09/2041		21 487	20 073	0,03
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/10/2036–1/03/2052		635 378	521 489	0,74
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/07/2037–1/04/2052		517 390	440 274	0,60
Fannie Mae, UMBS, 3,5 %, 1/07/2043–1/06/2050		125 694	116 302	0,15
Fannie Mae, UMBS, 1,5 %, 1/12/2050–1/03/2051		71 394	55 016	0,08
Fannie Mae, UMBS, 4 %, 1/08/2051–1/08/2052		69 456	65 858	0,09
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/12/2051–1/06/2052		110 335	97 013	0,13
Fannie Mae, UMBS, 4,5 %, 1/07/2052–1/09/2052		44 576	43 229	0,06
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/02/2053–1/06/2053		149 319	151 488	0,21
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/11/2053		49 905	50 157	0,07
Freddie Mac, 1,087 %, 25/04/2024 (i)		470 967	369	0,00
Freddie Mac, 0,773 %, 25/07/2024 (i)		890 794	1 388	0,00
Freddie Mac, 0,178 %, 25/05/2025 (i)		2 896 310	3 885	0,01
Freddie Mac, 5,698 %, 25/03/2027		13 577	13 431	0,02
Freddie Mac, 0,704 %, 25/07/2027 (i)		2 320 136	38 453	0,05
Freddie Mac, 0,549 %, 25/08/2027 (i)		1 717 972	22 257	0,03
Freddie Mac, 0,43 %, 25/01/2028 (i)		3 184 297	34 772	0,05
Freddie Mac, 0,436 %, 25/01/2028 (i)		1 373 326	15 482	0,02
Freddie Mac, 0,27 %, 25/02/2028 (i)		4 087 285	23 002	0,03
Freddie Mac, 0,262 %, 25/04/2028 (i)		2 618 753	14 328	0,02
Freddie Mac, 3 %, 15/06/2028–1/08/2045		140 160	128 517	0,19
Freddie Mac, 5,069 %, 25/10/2028		25 000	25 690	0,04
Freddie Mac, 5 %, 25/11/2028–1/12/2044		134 826	137 703	0,19
Freddie Mac, 4,724 %, 25/12/2028		53 753	54 538	0,07
Freddie Mac, 5,989 %, 25/03/2029		18 058	18 040	0,02
Freddie Mac, 5,978 %, 25/07/2029–25/09/2029		37 832	37 779	0,05
Freddie Mac, 5,979 %, 25/08/2029		16 474	16 444	0,02
Freddie Mac, 5,828 %, 25/12/2029		12 500	12 404	0,02

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Freddie Mac, 1,44 %, 25/01/2030 (i)	USD	131 377	8 441	0,01
Freddie Mac, 1,482 %, 25/06/2030 (i)		149 015	10 318	0,01
Freddie Mac, 4,94 %, 25/11/2030		36 069	37 021	0,05
Freddie Mac, 0,627 %, 25/01/2031 (i)		251 243	8 158	0,01
Freddie Mac, 0,871 %, 25/02/2032 (i)		147 071	7 416	0,01
Freddie Mac, 6,094 %, 25/09/2032		49 115	49 181	0,07
Freddie Mac, 0,301 %, 25/11/2032 (i)		364 551	5 340	0,01
Freddie Mac, 0,431 %, 25/05/2033 (i)		317 388	7 642	0,01
Freddie Mac, 3,5 %, 15/08/2033–15/08/2042		107 300	101 939	0,15
Freddie Mac, 0,299 %, 25/08/2033 (i)		400 067	5 780	0,01
Freddie Mac, 5,66 %, 15/04/2035		1 264	1 249	0,00
Freddie Mac, 5,5 %, 15/02/2036 (i)		6 459	1 149	0,00
Freddie Mac, 6 %, 15/10/2036		10 290	10 749	0,01
Freddie Mac, 4 %, 1/08/2037–15/04/2044		52 499	51 090	0,07
Freddie Mac, 4,5 %, 25/08/2037–1/05/2042		74 285	72 974	0,10
Freddie Mac, 5,71 %, 15/05/2041		7 727	7 471	0,01
Freddie Mac, 5,5 %, 1/09/2041		20 215	20 819	0,03
Freddie Mac Multi-Family Structured Pass-Through Certificates K-511, "A2", 4,86 %, 25/10/2028		71 043	72 443	0,10
Freddie Mac Multi-Family Structured Pass-Through Certificates K-511, "X-1", 0,612 %, 25/10/2028 (i)		197 005	3 854	0,01
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/03/2037–1/03/2052		570 522	463 419	0,65
Freddie Mac, UMBS, 4,5 %, 1/06/2038		23 610	23 430	0,03
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/02/2047–1/05/2052		27 754	25 784	0,04
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/03/2047–1/05/2052		164 721	145 323	0,20
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/11/2051–1/09/2052		86 928	73 188	0,11
Freddie Mac, UMBS, 5 %, 1/10/2052		73 166	72 297	0,10
Freddie Mac, UMBS, 5,5 %, 1/04/2053		23 732	24 094	0,03
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/10/2033–20/09/2052		161 402	159 690	0,22
Ginnie Mae, 5,675 %, 20/08/2034		14 636	14 982	0,02
Ginnie Mae, 4 %, 16/05/2039–20/03/2053		174 269	166 159	0,22
Ginnie Mae, 5 %, 20/08/2039–20/04/2053		80 445	79 981	0,11
Ginnie Mae, 5,901 %, 20/10/2039		3 342	3 318	0,00
Ginnie Mae, 5,551 %, 20/09/2041		54 815	53 807	0,07
Ginnie Mae, 4 %, 16/08/2042 (i)		19 728	2 826	0,00
Ginnie Mae, 3,5 %, 20/07/2043–20/09/2052		171 331	160 223	0,22
Ginnie Mae, 3 %, 20/04/2045–20/11/2052		202 236	181 876	0,24
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/08/2051–20/04/2052		288 231	249 232	0,34
Ginnie Mae, 2 %, 20/01/2052–20/03/2052		45 274	37 693	0,05
Ginnie Mae, 5,5 %, 20/02/2053		48 004	48 341	0,07
Ginnie Mae, 6 %, 20/11/2055		50 000	50 867	0,07
Ginnie Mae, 0,584 %, 16/02/2059 (i)		51 070	1 571	0,00
UMBS, TBA, 2 %, 25/02/2039–25/03/2039		150 000	134 753	0,18
			5 943 406	8,17
Obligations municipales				
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 2,746 %, 1/06/2034		30 000	25 050	0,03
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,682 %, 1/07/2027		25 000	23 549	0,03
Michigan Finance Authority Tobacco Settlement Asset-Backed Rev., Taxable (2006 Sold Tobacco Receipts), "A-1", 2,326 %, 1/06/2030		7 536	7 409	0,01
État de Floride, Taxable, "A", 2,154 %, 1/07/2030		47 000	40 154	0,06
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,497 %, 1/06/2024		20 000	19 742	0,03
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,647 %, 1/06/2025		20 000	19 052	0,03
			134 956	0,19
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 5 %, 23/03/2035		39 000	36 890	0,05

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair		Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Réseaux et télécommunications				
Iliad Holding S.A.S., 7 %, 15/10/2028	USD	200 000	198 407	0,27
Services pétroliers				
Nabors Industries Ltd., 7,25 %, 15/01/2026		39 000	38 028	0,05
Nabors Industries Ltd., 9,125 %, 31/01/2030		24 000	24 421	0,04
			62 449	0,09
Pétrole				
Parkland Corp., 4,625 %, 1/05/2030		110 000	101 345	0,14
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp., 6 %, 15/02/2028		58 000	56 688	0,08
			158 033	0,22
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
M&T Bank Corp., 4,553 % jusqu'au 16/08/2027, FLR jusqu'au 16/08/2028		47 000	45 371	0,06
Macquarie Group Ltd., 5,887 %, 15/06/2034		50 000	51 227	0,07
Shriram Transport Finance Co. Ltd., 6,625 %, 22/04/2027		200 000	201 500	0,28
Truist Financial Corp., 7,161 % jusqu'au 30/10/2028, FLR jusqu'au 30/10/2029		46 000	49 678	0,07
Truist Financial Corp., 5,711 % jusqu'au 24/01/2034, FLR jusqu'au 24/01/2035		22 000	22 371	0,03
			370 147	0,51
Ordinateurs personnels et périphériques				
NCR Voyix Corp., 5 %, 1/10/2028		67 000	63 166	0,09
NCR Voyix Corp., 5,125 %, 15/04/2029		42 000	39 296	0,05
			102 462	0,14
Produits pharmaceutiques				
1375209 BC Ltd., 9 %, 30/01/2028		13 000	12 610	0,02
1375209 BC Ltd., 9 %, 30/01/2028		27 000	26 190	0,04
Bausch Health Co., Inc., 11 %, 30/09/2028		47 000	31 974	0,04
Bausch Health Co., Inc., 14 %, 15/10/2030		9 000	5 031	0,01
Merck & Co., Inc., 2,75 %, 10/12/2051		26 000	17 452	0,02
Organon Finance 1 LLC, 5,125 %, 30/04/2031		200 000	171 825	0,24
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 4,75 %, 19/05/2033		86 000	85 893	0,12
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 5,3 %, 19/05/2053		13 000	13 218	0,02
Pfizer, Inc., 2,55 %, 28/05/2040		27 000	19 573	0,03
Roche Holdings, Inc., 5,338 %, 13/11/2028		59 000	61 145	0,08
Roche Holdings, Inc., 5,489 %, 13/11/2030		58 000	61 117	0,08
			506 028	0,70
Lutte contre la pollution				
GFL Environmental, Inc., 4,25 %, 1/06/2025		15 000	14 737	0,02
GFL Environmental, Inc., 4 %, 1/08/2028		63 000	57 788	0,08
GFL Environmental, Inc., 4,75 %, 15/06/2029		26 000	24 407	0,03
GFL Environmental, Inc., 4,375 %, 15/08/2029		25 000	22 928	0,03
GFL Environmental, Inc., 6,75 %, 15/01/2031		11 000	11 251	0,02
Stericycle, Inc., 3,875 %, 15/01/2029		75 000	68 177	0,09
Waste Management, Inc., 4,625 %, 15/02/2033		59 000	58 577	0,08
			257 865	0,35
Métaux et minéraux précieux				
Coeur Mining, Inc., 5,125 %, 15/02/2029		38 000	34 590	0,05
Eldorado Gold Corp., 6,25 %, 1/09/2029		37 000	35 288	0,05
IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15/10/2028		75 000	66 000	0,09
Northern Star Resources Ltd. Co., 6,125 %, 11/04/2033		51 000	51 980	0,07
			187 858	0,26
Chemins de fer et transport maritime				
Burlington Northern Santa Fe, LLC, 5,2 %, 15/04/2054		46 000	46 884	0,06
Canadian Pacific Railway Co., 3,1 %, 2/12/2051		38 000	26 845	0,04
			73 729	0,10
Immobilier - Bureaux				
Boston Properties LP, REIT, 3,65 %, 1/02/2026		33 000	31 870	0,04
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		32 000	26 886	0,04

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Immobilier - Bureaux, suite				
Corporate Office Property LP, REIT, 2,75 %, 15/04/2031	USD	48 000	39 187	0,05
			97 943	0,13
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		34 000	28 436	0,04
Extra Space Storage LP, 5,5 %, 1/07/2030		52 000	53 178	0,07
Lexington Realty Trust Co., REIT, 2,7 %, 15/09/2030		42 000	35 334	0,05
Lexington Realty Trust Co., REIT, 2,375 %, 1/10/2031		6 000	4 834	0,01
Prologis LP, REIT, 5,125 %, 15/01/2034		63 000	63 985	0,09
RHP Hotel Properties, LP/RHP Finance Corp., 7,25 %, 15/07/2028		84 000	86 588	0,12
W.P. Carey, Inc., REIT, 2,45 %, 1/02/2032		13 000	10 621	0,01
XHR LP, REIT, 4,875 %, 1/06/2029		48 000	44 271	0,06
			327 247	0,45
Immobilier - Distribution				
NNN REIT, Inc., 5,6 %, 15/10/2033		39 000	39 890	0,06
STORE Capital Corp., REIT, 2,75 %, 18/11/2030		59 000	46 895	0,06
			86 785	0,12
Restaurants				
Fertitta Entertainment LLC, 6,75 %, 15/01/2030		62 000	55 741	0,08
Distribution				
Alimentation Couche-Tard, Inc., 3,439 %, 13/05/2041		3 000	2 262	0,00
Alimentation Couche-Tard, Inc., 3,8 %, 25/01/2050		50 000	37 859	0,05
Amazon.com, Inc., 3,6 %, 13/04/2032		48 000	45 294	0,06
Asbury Automotive Group, Inc., 4,625 %, 15/11/2029		47 000	43 300	0,06
AutoZone, Inc., 4,75 %, 1/08/2032		37 000	36 360	0,05
Home Depot, Inc., 3,9 %, 15/06/2047		47 000	39 811	0,06
Lithia Motors, Inc., 3,875 %, 1/06/2029		54 000	48 465	0,07
Macy's Retail Holdings LLC, 5,875 %, 1/04/2029		63 000	61 110	0,08
NMG Holding Co. Inc./Neiman Marcus Group LLC, 7,125 %, 1/04/2026		42 000	40 951	0,06
Penske Automotive Group Co., 3,75 %, 15/06/2029		69 000	61 495	0,09
Victoria's Secret & Co., 4,625 %, 15/07/2029		53 000	44 810	0,06
			461 717	0,64
Produits chimiques spéciaux				
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,23 %, 1/10/2025		26 000	24 229	0,03
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027		13 000	11 519	0,02
International Flavors & Fragrances, Inc., 2,3 %, 1/11/2030		16 000	13 317	0,02
			49 065	0,07
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		19 000	16 155	0,02
DICK'S Sporting Goods, 4,1 %, 15/01/2052		30 000	21 725	0,03
Global Auto Holdings Ltd./Aag FH UK Ltd., 8,375 %, 15/01/2029		50 000	47 144	0,06
Michael Cos., Inc., 5,25 %, 1/05/2028		35 000	27 491	0,04
Michael Cos., Inc., 7,875 %, 1/05/2029		41 000	26 223	0,04
			138 738	0,19
Hypermarchés				
KeHE Distributors LLC/KeHE Finance Corp., 9 %, 15/02/2029		40 000	40 225	0,06
Télécommunications mobiles				
Crown Castle, Inc., REIT, 4,45 %, 15/02/2026		27 000	26 651	0,04
Crown Castle, Inc., REIT, 3,7 %, 15/06/2026		99 000	95 892	0,13
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032		65 000	59 123	0,08
Rogers Communications, Inc., 4,5 %, 15/03/2042		30 000	26 656	0,04
SBA Communications Corp., 3,875 %, 15/02/2027		36 000	34 356	0,05
SBA Communications Corp., 3,125 %, 1/02/2029		105 000	93 579	0,13
Telefónica Celular del Paraguay S.A., 5,875 %, 15/04/2027		200 000	193 920	0,27
T-Mobile USA, Inc., 3,5 %, 15/04/2025		24 000	23 530	0,03
T-Mobile USA, Inc., 2,05 %, 15/02/2028		35 000	31 579	0,04

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Télécommunications mobiles, suite				
T-Mobile USA, Inc., 5,05 %, 15/07/2033	USD	38 000	38 044	0,05
Vodafone Group PLC, 5,625 %, 10/02/2053		89 000	89 659	0,12
			712 989	0,98
Tabac				
B.A.T. Capital Corp., 6,343 %, 2/08/2030		44 000	46 329	0,06
Philip Morris International, Inc., 5,625 %, 17/11/2029		19 000	19 829	0,03
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 15/02/2030		48 000	48 791	0,07
			114 949	0,16
Transports - Services				
Element Fleet Management Corp., 6,271 %, 26/06/2026		35 000	35 633	0,05
Element Fleet Management Corp., 6,319 %, 4/12/2028		54 000	56 116	0,08
			91 749	0,13
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/02/2042		362 000	273 932	0,38
Obligations du Trésor américain, 3,25 %, 15/05/2042		46 000	39 831	0,05
Obligations du Trésor américain, 3,875 %, 15/02/2043		43 000	40 479	0,06
Obligations du Trésor américain, 3,875 %, 15/05/2043		437 000	411 190	0,57
Obligations du Trésor américain, 4,375 %, 15/08/2043		101 000	101 726	0,14
Obligations du Trésor américain, 2,5 %, 15/02/2045		20 000	14 905	0,02
Obligations du Trésor américain, 2,5 %, 15/02/2046		113 000	83 192	0,11
Obligations du Trésor américain, 4,125 %, 15/08/2053		16 000	15 732	0,02
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 31/03/2024		400 000	397 953	0,55
Bons du Trésor américain, 2,5 %, 15/05/2024		22 000	21 824	0,03
Bons du Trésor américain, 3 %, 30/06/2024		91 000	90 197	0,12
Bons du Trésor américain, 2 %, 15/02/2025		405 000	393 799	0,54
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 31/03/2025		76 000	75 368	0,10
Bons du Trésor américain, 2,875 %, 31/07/2025		449 000	439 073	0,60
Bons du Trésor américain, 0,875 %, 30/09/2026		210 000	193 471	0,27
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 15/08/2027		560 000	528 784	0,73
Bons du Trésor américain, 3,625 %, 31/03/2028		367 000	362 986	0,50
Bons du Trésor américain, 2,875 %, 30/04/2029		43 000	40 927	0,06
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 30/09/2029		182 000	181 616	0,25
Bons du Trésor américain, 1,625 %, 15/05/2031		94 000	80 561	0,11
Bons du Trésor américain, 2,75 %, 15/08/2032		478 000	436 679	0,60
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 15/08/2033		58 000	57 655	0,08
			4 281 880	5,89
Services publics - Énergie électrique				
Adani Transmission Ltd., 4,25 %, 21/05/2036		157 000	131 122	0,18
AEP Transmission Co. LLC, 5,4 %, 15/03/2053		31 000	31 581	0,04
AES Gener S.A., 7,125 %, 26/03/2079		200 000	191 840	0,26
Alabama Power Co., 3,45 %, 1/10/2049		75 000	56 518	0,08
American Electric Power Co., Inc., 5,699 %, 15/08/2025		11 000	11 085	0,02
American Transmission Systems, Inc., 2,65 %, 15/01/2032		42 000	35 308	0,05
Berkshire Hathaway Energy Co., 5,15 %, 15/11/2043		11 000	10 901	0,02
Berkshire Hathaway Energy Co., 4,6 %, 1/05/2053		9 000	7 950	0,01
Buffalo Energy Mexico Holdings, S.A. de C.V., 7,875 %, 15/02/2039		200 000	206 780	0,28
Calpine Corp., 4,5 %, 15/02/2028		74 000	70 372	0,10
Calpine Corp., 5,125 %, 15/03/2028		56 000	53 436	0,07
CenterPoint Energy, Inc., 2,65 %, 1/06/2031		27 000	22 941	0,03
Clearway Energy Operating LLC, 4,75 %, 15/03/2028		48 000	45 701	0,06
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/02/2031		124 000	107 487	0,15
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/01/2032		10 000	8 493	0,01
Duke Energy Carolinas LLC, 2,85 %, 15/03/2032		71 000	61 447	0,08
Duke Energy Florida LLC, 6,2 %, 15/11/2053		24 000	26 857	0,04
Enel Finance International N.V., 2,25 %, 12/07/2031		200 000	163 103	0,22

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services publics - Énergie électrique, suite				
EPH Financing International A.S., 6,651 %, 13/11/2028	EUR	195 000	215 334	0,30
Eversource Energy, 5,5 %, 1/01/2034	USD	33 000	33 378	0,05
FirstEnergy Corp., 2,65 %, 1/03/2030		71 000	61 690	0,08
Florida Power & Light Co., 3,95 %, 1/03/2048		50 000	41 822	0,06
Georgia Power Co., 4,7 %, 15/05/2032		76 000	75 048	0,10
Georgia Power Co., 5,125 %, 15/05/2052		35 000	34 512	0,05
Greenko Dutch B.V. (République de l'Inde), 3,85 %, 29/03/2026		185 000	173 900	0,24
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		46 000	38 771	0,05
MidAmerican Energy Co., 5,85 %, 15/09/2054		45 000	49 183	0,07
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 6,051 %, 1/03/2025		27 000	27 228	0,04
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 5,749 %, 1/09/2025		25 000	25 252	0,03
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 2,44 %, 15/01/2032		40 000	33 168	0,05
NextEra Energy, Inc., 4,25 %, 15/07/2024		6 000	5 937	0,01
NextEra Energy, Inc., 4,25 %, 15/09/2024		12 000	11 730	0,02
NextEra Energy, Inc., 4,5 %, 15/09/2027		57 000	53 525	0,07
NextEra Energy, Inc., 7,25 %, 15/01/2029		59 000	60 770	0,08
Pacific Gas & Electric Co., 6,1 %, 15/01/2029		18 000	18 649	0,03
Pacific Gas & Electric Co., 2,5 %, 1/02/2031		52 000	43 160	0,06
PPL Electric Utilities Corp., 4,85 %, 15/02/2034		32 000	32 097	0,04
Southern California Edison Co., 4,5 %, 1/09/2040		15 000	13 457	0,02
Southern California Edison Co., 3,65 %, 1/02/2050		25 000	19 011	0,03
TerraForm Global Operating LLC, 6,125 %, 1/03/2026		50 000	49 345	0,07
TerraForm Power Operating LLC, 5 %, 31/01/2028		75 000	72 286	0,10
TerraForm Power Operating LLC, 4,75 %, 15/01/2030		43 000	39 702	0,05
Virginia Electric & Power Co., 2,875 %, 15/07/2029		26 000	24 010	0,03
WEC Energy Group, Inc., 4,75 %, 9/01/2026		76 000	75 823	0,10
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032		35 000	33 955	0,05
			2 605 665	3,58
Total des obligations (coût identifié, 50 523 058 \$)			48 657 255	66,91
ACTIONS ORDINAIRES				
Aérospatiale et défense				
General Dynamics Corp.		1 063	281 684	0,39
Boissons alcoolisées				
Ambev S.A.		14 700	38 809	0,05
Kirin Holdings Co. Ltd.		9 400	135 861	0,19
			174 670	0,24
Industrie automobile				
Bridgestone Corp.		2 700	117 369	0,16
Stellantis N.V.		4 481	98 710	0,14
Tofas Turk Otomobil Fabrikasi A.S.		3 667	29 776	0,04
			245 855	0,34
Biotechnologies				
Biogen, Inc.		125	30 832	0,04
Radio-télévision				
Omnicom Group, Inc.		3 175	286 956	0,39
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Bank of New York Mellon Corp.		4 777	264 932	0,36
Services aux entreprises				
SCSK Corp.		2 000	39 328	0,05
TriNet Group, Inc.		406	46 162	0,06
Verisk Analytics, Inc., "A"		228	55 069	0,08
			140 559	0,19
Télévision par câble				
Comcast Corp., "A"		5 762	268 163	0,37

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Télévision par câble, suite			
Intelsat Emergence S.A.	1 038	27 248	0,04
		295 411	0,41
Produits chimiques			
Nutrien Ltd.	423	21 093	0,03
Logiciels			
Microsoft Corp.	226	89 853	0,12
Logiciels - Systèmes			
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	73 000	238 109	0,33
Lenovo Group Ltd.	72 000	74 500	0,10
Samsung Electronics Co. Ltd.	2 099	113 818	0,16
Seagate Technology Holdings PLC	418	35 814	0,05
		462 241	0,64
Construction			
American Homes 4 Rent, "A", REIT	9 950	348 747	0,48
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	34 500	69 195	0,09
AvalonBay Communities, Inc., REIT	793	141 955	0,20
Compagnie de Saint-Gobain S.A.	1 996	141 346	0,19
Essex Property Trust, Inc., REIT	1 216	283 656	0,39
Heidelberg Materials AG	1 620	150 353	0,21
Mid-America Apartment Communities, Inc., REIT	2 261	285 745	0,39
Zhejiang Supor Co. Ltd., "A"	4 800	33 863	0,05
		1 454 860	2,00
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	2 964	249 569	0,34
Kenvue, Inc.	1 767	36 683	0,05
Kimberly-Clark Corp.	3 115	376 822	0,52
Procter & Gamble Co.	195	30 642	0,04
		693 716	0,95
Équipements électriques			
Mitsubishi Electric Corp.	3 200	47 125	0,07
Électronique			
Broadcom, Inc.	68	80 240	0,11
Lam Research Corp.	196	161 733	0,22
Novatek Microelectronics Corp.	6 000	97 407	0,14
NVIDIA Corp.	131	80 600	0,11
		419 980	0,58
Énergie - Sociétés indépendantes			
Phillips 66	2 808	405 223	0,56
Valero Energy Corp.	1 147	159 318	0,22
		564 541	0,78
Énergie - Sociétés intégrées			
Aker BP ASA	2 173	57 628	0,08
Eni S.p.A.	12 761	204 105	0,28
Exxon Mobil Corp.	590	60 658	0,08
LUKOIL PJSC (c)	606	0	0,00
PetroChina Co. Ltd.	292 000	209 166	0,29
Suncor Energy, Inc.	2 667	88 315	0,12
TotalEnergies SE	3 039	197 924	0,27
		817 796	1,12
Ingénierie - Construction			
ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.	1 013	39 990	0,06
Doosan Bobcat, Inc.	2 015	75 788	0,10
		115 778	0,16
Alimentation et boissons			
Archer Daniels Midland Co.	1 311	72 865	0,10

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Alimentation et boissons, suite			
General Mills, Inc.	4 757	308 777	0,43
J.M. Smucker Co.	665	87 481	0,12
WH Group Ltd.	40 000	23 536	0,03
		492 659	0,68
Magasins d'alimentation et pharmacies			
BIM Birllesik Magazalar A.S.	6 023	75 622	0,10
Tesco PLC	59 549	216 051	0,30
Wesfarmers Ltd.	1 257	47 825	0,07
		339 498	0,47
Produits forestiers et papier			
Rayonier, Inc., REIT	5 641	170 923	0,23
Weyerhaeuser Co., REIT	7 025	230 209	0,32
		401 132	0,55
Jeux et hôtellerie			
Aristocrat Leisure Ltd.	1 359	39 169	0,05
Organisations de soins de santé intégrés			
Cigna Group	702	211 267	0,29
Assurances			
China Pacific Insurance Co. Ltd.	12 200	22 346	0,03
DB Insurance Co. Ltd.	559	36 576	0,05
Equitable Holdings, Inc.	7 853	256 715	0,35
Hartford Financial Services Group, Inc.	1 096	95 308	0,13
Manulife Financial Corp.	16 779	370 911	0,51
MetLife, Inc.	2 244	155 554	0,21
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	832	164 078	0,23
		1 101 488	1,51
Machines et outils			
Timken Co.	402	32 928	0,04
Volvo Group	6 941	165 757	0,23
		198 685	0,27
Grandes banques			
ABN AMRO Group N.V., GDR	5 223	77 238	0,10
BNP Paribas	2 569	172 742	0,24
DBS Group Holdings Ltd.	13 500	319 652	0,44
Erste Group Bank AG	1 288	55 747	0,08
		625 379	0,86
Technologies et services médicaux et de santé			
Encompass Health Corp.	4 223	300 002	0,41
McKesson Corp.	445	222 451	0,31
Universal Health Services, Inc.	1 727	274 265	0,38
		796 718	1,10
Métaux et exploitation minière			
Fortescue Ltd.	2 176	42 279	0,06
Glencore PLC	7 656	40 794	0,05
Rio Tinto PLC	5 388	375 756	0,52
Toyota Tsusho Corp.	1 000	65 457	0,09
Vale S.A.	5 800	79 325	0,11
		603 611	0,83
Services pétroliers			
LTRI Holdings LP (b)	105	53 148	0,07
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
China Construction Bank Corp.	108 000	64 013	0,09
KB Financial Group, Inc.	855	36 259	0,05
M&T Bank Corp.	490	67 669	0,09

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Autres banques et établissements financiers diversifiés, suite			
Sberbank of Russia PJSC (c)	58 864	0	0,00
		167 941	0,23
Produits pharmaceutiques			
AbbVie, Inc.	2 376	390 614	0,54
Johnson & Johnson	1 656	263 138	0,36
Merck & Co., Inc.	474	57 250	0,08
Novartis AG	1 839	190 517	0,26
Organon & Co.	12 915	215 035	0,29
Pfizer, Inc.	2 198	59 522	0,08
Roche Holding AG	1 367	390 576	0,54
Sanofi	912	91 575	0,13
		1 658 227	2,28
Imprimerie et édition			
Lamar Advertising Co., REIT	999	104 575	0,14
Immobilier			
Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT	2 661	321 715	0,44
Boston Properties, Inc., REIT	3 957	263 141	0,36
Brixmor Property Group, Inc., REIT	19 236	431 656	0,59
Broadstone Net Lease, Inc., REIT	1 206	19 380	0,03
CubeSmart, REIT	7 134	308 331	0,42
Douglas Emmett, Inc., REIT	11 288	152 952	0,21
Equity Lifestyle Properties, Inc., REIT	6 210	420 355	0,58
Extra Space Storage, Inc., REIT	3 156	455 853	0,63
Farmland Partners, Inc., REIT	7 980	89 536	0,12
Federal Realty Investment Trust, REIT	3 432	349 137	0,48
Kimco Realty Corp., REIT	9 912	200 222	0,28
NNN REIT, Inc.	7 753	312 756	0,43
Phillips Edison & Co., REIT	4 653	161 506	0,22
Prologis, Inc., REIT	6 848	867 573	1,19
Rexford Industrial Realty, Inc., REIT	4 359	229 240	0,32
Sun Communities, Inc., REIT	4 159	521 331	0,72
		5 104 684	7,02
Restaurants			
Sodexo	1 885	213 082	0,29
Texas Roadhouse, Inc.	340	42 745	0,06
		255 827	0,35
Produits chimiques spéciaux			
Chemours Co.	1 163	35 088	0,05
Magasins spécialisés			
Home Depot, Inc.	342	120 712	0,17
Ross Stores, Inc.	487	68 316	0,09
Target Corp.	1 219	169 539	0,23
		358 567	0,49
Télécommunications mobiles			
KDDI Corp.	9 600	317 659	0,44
SBA Communications Corp., REIT	1 594	356 833	0,49
		674 492	0,93
Services téléphoniques			
Digital Realty Trust, Inc., REIT	1 941	272 633	0,38
Equinix, Inc., REIT	1 056	876 237	1,20
Hellenic Telecommunications Organization S.A.	6 221	86 391	0,12
		1 235 261	1,70
Tabac			
British American Tobacco PLC	5 871	173 367	0,24

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Diversified Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Tabac, suite				
Japan Tobacco, Inc.		7 700	202 968	0,28
			376 335	0,52
Services publics - Énergie électrique				
Edison International		3 572	241 039	0,33
Iberdrola S.A.		8 745	105 362	0,15
PG&E Corp.		3 190	53 815	0,07
Vistra Corp.		1 340	54 980	0,08
			455 196	0,63
Total des actions ordinaires (coût identifié, 21 343 276 \$)			21 696 829	29,83
ACTIONS PRIVILÉGIÉES				
Métaux et exploitation minière				
Gerdau S.A. (coût identifié, 166 605 \$)		31 865	135 322	0,19
OBLIGATIONS CONVERTIBLES				
Services publics - Énergie électrique				
Pacific Gas and Electric Corp., 4,25 %, 1/12/2027 (coût identifié, 54 000 \$)	USD	54 000	54 945	0,08
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 200 000 \$)	USD	200 000	199 971	0,27
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 72 286 939 \$) (k)			70 744 322	97,28
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			1 980 583	2,72
ACTIF NET			72 724 905	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Angola				
République d'Angola, 8,75 %, 14/04/2032	USD	8 166 000	7 007 669	0,31
République d'Angola, 9,375 %, 8/05/2048		9 084 000	7 285 913	0,32
République d'Angola, 9,125 %, 26/11/2049		26 486 000	20 932 045	0,93
			35 225 627	1,56
Argentine				
République argentine, 3,625 %, 9/07/2035		30 434 000	10 155 447	0,45
République argentine, 4,25 %, 9/01/2038		29 478 000	11 347 094	0,50
République argentine, 3,5 %, 9/07/2041		56 110 000	18 689 787	0,83
SCC Power PLC, 8 % (8 % liquidités ou 4 % liquidités + 4 % PIK) jusqu'au 15/06/2024, 8 % liquidités au 31/12/2028 (p)		2 401 716	1 122 802	0,05
SCC Power PLC, 4 % (4 % liquidités ou 4 % PIK) jusqu'au 15/06/2024, 4 % liquidités au 17/05/2032 (p)		1 858 556	315 026	0,01
			41 630 156	1,84
Azerbaïdjan				
République d'Azerbaïdjan, 3,5 %, 1/09/2032		9 398 000	8 045 628	0,36
Southern Gas Corridor CJSC (République d'Azerbaïdjan), 6,875 %, 24/03/2026		10 826 000	10 958 077	0,48
			19 003 705	0,84
Bénin				
République du Bénin, 4,875 %, 19/01/2032	EUR	2 647 000	2 319 729	0,10
Bermudes				
Gouvernement des Bermudes, 2,375 %, 20/08/2030	USD	8 029 000	6 754 798	0,30
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		5 414 000	5 251 580	0,23
Gouvernement des Bermudes, 3,375 %, 20/08/2050		5 590 000	3 759 275	0,17
			15 765 653	0,70

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Brésil				
3R Lux S.à r.l., 9,75 %, 5/02/2031	USD	4 812 000	4 797 564	0,21
Acu Petroleo Luxembourg S.à r.l., 7,5 %, 13/01/2032		6 202 201	5 942 884	0,26
Aegea Finance S.à r.l., 6,75 %, 20/05/2029		1 414 000	1 372 233	0,06
Aegea Finance S.à r.l., 9 %, 20/01/2031		5 605 000	5 895 059	0,26
Ambipar Lux S.à r.l., 9,875 %, 6/02/2031		5 212 000	5 180 728	0,23
Braskem Netherlands B.V., 4,5 %, 10/01/2028		2 699 000	2 342 180	0,10
Braskem Netherlands B.V., 7,25 %, 13/02/2033		3 962 000	3 534 668	0,16
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2025	BRL	30 313 000	6 114 782	0,27
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2027		74 708 000	15 121 651	0,67
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2029		87 411 000	17 479 025	0,77
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2031		17 181 000	3 386 626	0,15
République fédérative du Brésil, 6,125 %, 15/03/2034	USD	4 678 000	4 636 324	0,21
République fédérative du Brésil, 7,125 %, 13/05/2054		7 679 000	7 673 333	0,34
FS Luxembourg S.à r.l., 8,875 %, 12/02/2031		6 064 000	5 984 562	0,27
Hidrovias International Finance S.à r.l., 4,95 %, 8/02/2031		3 380 000	2 773 304	0,12
MC Brazil Downstream Trading S.à r.l., 7,25 %, 30/06/2031		7 634 478	5 869 552	0,26
Minerva Luxembourg S.A., 8,875 %, 13/09/2033		4 958 000	5 195 155	0,23
Samarco Mineracao S.A., 9,05 % PIK jusqu'au 30/03/2024, 9 % PIK jusqu'au 30/12/2025, (4 % liquidités + 5 % PIK) jusqu'au 30/12/2026, (5,5 % liquidités + 3,5 % PIK) jusqu'au 30/12/2027, 9,25 % liquidités jusqu'au 30/12/2029, 9,5 % Liquidités au 30/06/2031 (p)		5 400 000	4 490 394	0,20
Sítios Latinoamerica, S.A.B. de C.V., 5,375 %, 4/04/2032		3 710 000	3 455 228	0,15
			111 245 252	4,92
Bulgarie				
Bulgarian Energy Holdings, 2,45 %, 22/07/2028	EUR	7 471 000	7 042 065	0,31
République de Bulgarie, 4,875 %, 13/05/2036		5 744 000	6 592 534	0,29
			13 634 599	0,60
Chili				
AES Gener S.A., 6,35 % jusqu'au 7/04/2025, FLR jusqu'au 7/10/2079	USD	5 823 000	5 505 181	0,24
Agrosuper S.A., 4,6 %, 20/01/2032		2 109 000	1 801 484	0,08
Alfa Desarrollo S.p.A., 4,55 %, 27/09/2051		4 215 534	3 079 570	0,14
Banco del Estado de Chile, 2,704 %, 9/01/2025		7 387 000	7 169 919	0,32
Chile Electricity Lux MPC S.à r.l., 6,01 %, 20/01/2033		5 269 000	5 382 389	0,24
Chile Electricity PEC S.p.A., 0 %, 25/01/2028		3 019 000	2 421 238	0,11
Codelco, Inc. (République du Chili), 5,95 %, 8/01/2034		12 700 000	12 705 572	0,56
Codelco, Inc. (République du Chili), 6,44 %, 26/01/2036		3 818 000	3 898 025	0,17
Codelco, Inc. (République du Chili), 6,3 %, 8/09/2053		1 371 000	1 344 675	0,06
Colbun S.A., 3,95 %, 11/10/2027		2 293 000	2 205 707	0,10
Compania Cervecerias Unidas S.A., 3,35 %, 19/01/2032		7 784 000	6 682 564	0,29
E.CL S.A., 4,5 %, 29/01/2025		2 411 000	2 376 258	0,10
Empresa Nacional del Petroleo (République du Chili), 3,75 %, 5/08/2026		2 523 000	2 390 395	0,10
Empresa Nacional del Petroleo (République du Chili), 5,25 %, 6/11/2029		5 754 000	5 560 792	0,25
Empresa Nacional del Petroleo (République du Chili), 3,45 %, 16/09/2031		6 165 000	5 186 028	0,23
Empresa Nacional del Petroleo (République du Chili), 6,15 %, 10/05/2033		4 876 000	4 863 217	0,21
Enel Chile S.A., 4,875 %, 12/06/2028		2 418 000	2 391 490	0,11
ENGIE Energía Chile S.A., 3,4 %, 28/01/2030		7 171 000	6 274 651	0,28
Mercury Chile Holdco LLC, 6,5 %, 24/01/2027		6 330 000	5 886 513	0,26
République du Chili, 2,55 %, 27/07/2033		5 675 000	4 672 920	0,21
République du Chili, 3,5 %, 31/01/2034		4 911 000	4 333 402	0,19
République du Chili, 5,33 %, 5/01/2054		1 861 000	1 806 359	0,08
Transelec S.A., 3,875 %, 12/01/2029		1 692 000	1 574 752	0,07
			99 513 101	4,40
Chine				
CCBL (Cayman) 1 Corp. Ltd., 3,5 %, 16/05/2024		4 041 000	4 016 407	0,18
Country Garden Holdings Co. Ltd., 2,7 %, 12/07/2026 (d)		814 000	58 689	0,00
Country Garden Holdings Co. Ltd., 4,8 %, 6/08/2030 (d)		315 000	24 019	0,00

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Chine, suite				
Country Garden Holdings Co. Ltd., 3,875 %, 22/10/2030 (d)	USD	1 156 000	95 150	0,00
Country Garden Holdings Co. Ltd., 3,3 %, 12/01/2031 (d)		935 000	71 294	0,00
Huarong Finance 2019 Co. Ltd. (République populaire de Chine), 3,25 %, 13/11/2024		3 869 000	3 755 058	0,17
Huarong Finance II Co. Ltd. (République populaire de Chine), 5,5 %, 16/01/2025		1 667 000	1 641 995	0,07
ICBCIL Finance Co. Ltd. (République populaire de Chine), 2,65 %, 2/08/2031		2 552 000	2 149 815	0,10
Meituan, 2,125 %, 28/10/2025		3 939 000	3 716 928	0,17
Prosus N.V., 3,061 %, 13/07/2031		3 860 000	3 142 005	0,14
State Grid Overseas Investment (2016) Ltd. (République populaire de Chine), 3,5 %, 4/05/2027		5 344 000	5 178 460	0,23
Sunac China Holdings Ltd., 6 %, 30/09/2025 (p)		259 617	33 880	0,00
Sunac China Holdings Ltd., 6,25 %, 30/09/2026 (p)		259 617	30 806	0,00
Sunac China Holdings Ltd., 6,5 %, 30/09/2027 (p)		519 235	50 625	0,00
Sunac China Holdings Ltd., 6,75 %, 30/09/2028 (p)		778 854	68 150	0,00
Sunac China Holdings Ltd., 7 %, 30/09/2029 (p)		778 854	60 361	0,00
Sunac China Holdings Ltd., 7,25 %, 30/09/2030 (p)		365 869	25 794	0,00
Tencent Holdings Ltd., 2,88 %, 22/04/2031		5 123 000	4 482 866	0,20
Times China Holdings Ltd., 6,75 %, 8/07/2025 (d)		2 950 000	92 925	0,00
Times China Holdings Ltd., 6,2 %, 22/03/2026 (d)		3 150 000	102 375	0,01
Weibo Corp., 3,375 %, 8/07/2030		9 037 000	7 839 055	0,35
			36 636 657	1,62
Colombie				
Banco GNB Sudameris S.A., 7,5 % jusqu'au 16/04/2026, FLR jusqu'au 16/04/2031		2 762 000	2 346 319	0,10
Ecopetrol S.A. (République de Colombie), 8,375 %, 19/01/2036		4 285 000	4 339 420	0,19
EnfraGen Energia Sur S.A., 5,375 %, 30/12/2030		7 507 000	5 876 579	0,26
République de Colombie, 3,125 %, 15/04/2031		10 960 000	8 759 052	0,39
République de Colombie, 3,25 %, 22/04/2032		7 215 000	5 647 429	0,25
République de Colombie, 8 %, 20/04/2033		2 121 000	2 253 409	0,10
République de Colombie, 8 %, 14/11/2035		4 276 000	4 502 137	0,20
République de Colombie, 5,2 %, 15/05/2049		3 421 000	2 524 710	0,11
République de Colombie, 8,75 %, 14/11/2053		5 149 000	5 611 810	0,25
Sierracol Energy Andina LLC, 6 %, 15/06/2028		6 594 000	5 552 214	0,25
TermoCandelaria Power Ltd., 7,875 %, 30/01/2029		2 184 700	2 141 006	0,09
			49 554 085	2,19
Costa Rica				
Liberty Costa Rica Senior Secured Finance, 10,875 %, 15/01/2031		3 176 000	3 247 244	0,14
République du Costa Rica, 6,55 %, 3/04/2034		9 882 000	10 109 319	0,45
République du Costa Rica, 7 %, 4/04/2044		4 271 000	4 326 361	0,19
République du Costa Rica, 7,158 %, 12/03/2045		2 345 000	2 410 462	0,11
République du Costa Rica, 7,3 %, 13/11/2054		9 512 000	9 953 382	0,44
			30 046 768	1,33
Côte d'Ivoire				
République de Côte d'Ivoire, 5,25 %, 22/03/2030	EUR	4 802 000	4 704 302	0,21
République de Côte d'Ivoire, 4,875 %, 30/01/2032		9 110 000	8 245 337	0,36
République de Côte d'Ivoire, 7,625 %, 30/01/2033	USD	5 360 000	5 309 080	0,24
République de Côte d'Ivoire, 8,25 %, 30/01/2037		7 855 000	7 803 942	0,35
République de Côte d'Ivoire, 6,875 %, 17/10/2040	EUR	5 124 000	4 616 067	0,20
			30 678 728	1,36
République tchèque				
CEZ A.S. (République tchèque), 2,375 %, 6/04/2027		3 641 000	3 776 035	0,17
République tchèque, 2,75 %, 23/07/2029	CZK	78 080 000	3 246 247	0,14
République tchèque, 5 %, 30/09/2030		108 280 000	5 071 617	0,22
République tchèque, 2 %, 13/10/2033		232 170 000	8 630 119	0,38
EP Infrastructure A.S., 2,045 %, 9/10/2028	EUR	1 244 000	1 144 117	0,05
EP Infrastructure A.S., 1,816 %, 2/03/2031		3 370 000	2 867 169	0,13
EPH Financing International A.S., 6,651 %, 13/11/2028		4 069 000	4 493 300	0,20

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
République tchèque, suite				
PPF Telecom Group B.V., 3,25 %, 29/09/2027	EUR	3 094 000	3 242 092	0,14
			32 470 696	1,43
République dominicaine				
République dominicaine, 5,5 %, 22/02/2029	USD	6 125 000	5 925 060	0,26
République dominicaine, 4,5 %, 30/01/2030		2 694 000	2 450 533	0,11
République dominicaine, 7,05 %, 3/02/2031		3 982 000	4 139 808	0,18
République dominicaine, 4,875 %, 23/09/2032		28 278 000	25 204 781	1,11
République dominicaine, 6 %, 22/02/2033		10 610 000	10 243 681	0,45
République dominicaine, 5,3 %, 21/01/2041		6 144 000	5 160 960	0,23
République dominicaine, 5,875 %, 30/01/2060		15 966 000	13 520 368	0,60
Empresa Generadora de Electricidad Haina S.A., 5,625 %, 8/11/2028		2 270 000	2 045 838	0,09
			68 691 029	3,03
Équateur				
République d'Équateur, 3,5 %, 31/07/2035		26 378 771	10 720 930	0,47
République d'Équateur, 2,5 %, 31/07/2040		30 165 546	10 972 718	0,49
			21 693 648	0,96
Égypte				
République arabe d'Égypte, 5,875 %, 16/02/2031		11 581 000	7 537 378	0,33
République arabe d'Égypte, 7,625 %, 29/05/2032		8 887 000	6 018 774	0,27
République arabe d'Égypte, 7,3 %, 30/09/2033		10 879 000	7 153 160	0,32
République arabe d'Égypte, 8,5 %, 31/01/2047		14 907 000	9 085 071	0,40
République arabe d'Égypte, 7,903 %, 21/02/2048		1 905 000	1 128 716	0,05
République arabe d'Égypte, 8,7 %, 1/03/2049		7 154 000	4 401 928	0,19
République arabe d'Égypte, 8,875 %, 29/05/2050		7 207 000	4 508 094	0,20
République arabe d'Égypte, 7,5 %, 16/02/2061		5 241 000	3 002 789	0,13
			42 835 910	1,89
Salvador				
République du Salvador, 6,375 %, 18/01/2027		1 284 000	1 142 760	0,05
République du Salvador, 8,625 %, 28/02/2029		2 455 000	2 213 183	0,10
République du Salvador, 8,25 %, 10/04/2032		2 536 000	2 168 280	0,10
République du Salvador, 7,65 %, 15/06/2035		2 992 000	2 336 752	0,10
République du Salvador, 7,124 %, 20/01/2050		3 141 000	2 237 962	0,10
			10 098 937	0,45
Gabon				
République du Gabon, 7 %, 24/11/2031		4 029 000	3 290 807	0,14
Ghana				
République du Ghana, 8,625 %, 7/04/2034 (d)		2 888 000	1 274 330	0,06
République du Ghana, 7,875 %, 11/02/2035 (d)		11 986 000	5 293 066	0,23
			6 567 396	0,29
Guatemala				
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029		4 288 000	4 005 549	0,18
CT Trust, 5,125 %, 3/02/2032		1 784 000	1 570 036	0,07
Energuate Trust, 5,875 %, 3/05/2027		5 328 000	5 074 920	0,22
Investment Energy Resources Ltd., 6,25 %, 26/04/2029		1 246 000	1 184 909	0,05
Millicom International Cellular S.A., 4,5 %, 27/04/2031		4 130 000	3 479 525	0,15
République du Guatemala, 5,25 %, 10/08/2029		910 000	879 382	0,04
République du Guatemala, 4,9 %, 1/06/2030		920 000	874 552	0,04
République du Guatemala, 3,7 %, 7/10/2033		6 077 000	4 973 826	0,22
			22 042 699	0,97
Hongrie				
Hungarian Development Bank PLC, 6,5 %, 29/06/2028		4 082 000	4 176 000	0,18
Magyar Export-Import Bank PLC (République de Hongrie), 6,125 %, 4/12/2027		4 897 000	4 934 922	0,22
Magyar Export-Import Bank PLC (République de Hongrie), 6 %, 16/05/2029	EUR	4 875 000	5 546 586	0,24
MVM Energetika Zartokouen Mukodo Reszvenytarsasag (République de Hongrie), 0,875 %, 18/11/2027		5 922 000	5 503 476	0,24

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Hongrie, suite				
République de Hongrie, 6,125 %, 22/05/2028	USD	1 983 000	2 039 714	0,09
République de Hongrie, 5,25 %, 16/06/2029		4 031 000	3 990 690	0,18
République de Hongrie, 6,25 %, 22/09/2032		3 020 000	3 151 581	0,14
République de Hongrie, 5,5 %, 16/06/2034		9 969 000	9 869 310	0,44
République de Hongrie, 5,5 %, 26/03/2036		7 638 000	7 477 908	0,33
République de Hongrie, 6,75 %, 25/09/2052		1 719 000	1 844 315	0,08
			48 534 502	2,14
Inde				
Adani Green Energy (UP) Ltd./Prayatna Developers Private Ltd., 6,25 %, 10/12/2024		6 440 000	6 382 362	0,28
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd., 4,375 %, 3/07/2029		2 680 000	2 408 503	0,11
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd., 5 %, 2/08/2041		2 963 000	2 383 039	0,10
Adani Transmission Ltd., 4 %, 3/08/2026		1 552 000	1 458 880	0,06
Adani Transmission Ltd., 4,25 %, 21/05/2036		8 721 350	7 283 826	0,32
Azure Power Energy Ltd., 3,575 %, 19/08/2026		6 607 894	6 056 293	0,27
Cliffon Ltd., 6,25 %, 25/10/2025		2 928 000	2 906 040	0,13
Continuum Energy Aura Pte. Ltd., 9,5 %, 24/02/2027		4 862 000	5 034 576	0,22
Export-Import Bank of India, 3,25 %, 15/01/2030		2 663 000	2 408 895	0,11
Export-Import Bank of India, 2,25 %, 13/01/2031		12 273 000	10 153 453	0,45
Export-Import Bank of India, 5,5 %, 18/01/2033		8 386 000	8 516 334	0,38
Greenko Dutch B.V. (République de l'Inde), 3,85 %, 29/03/2026		4 705 475	4 423 146	0,19
Greenko Power II Ltd. (République de l'Inde), 4,3 %, 13/12/2028		2 205 000	1 998 546	0,09
Greenko Wind Projects (Mauritius) Ltd., 5,5 %, 6/04/2025		3 390 000	3 339 489	0,15
Indian Railway Finance Corp., 3,249 %, 13/02/2030		1 720 000	1 537 447	0,07
Indian Railway Finance Corp., 2,8 %, 10/02/2031		11 215 000	9 542 157	0,42
JSW Hydro Energy Ltd., 4,125 %, 18/05/2031		3 643 430	3 180 241	0,14
JSW Infrastructure Ltd., 4,95 %, 21/01/2029		3 608 000	3 384 303	0,15
Power Finance Corp. Ltd. (République de l'Inde), 3,95 %, 23/04/2030		1 197 000	1 103 346	0,05
ReNew Power, 4,5 %, 14/07/2028		2 337 000	2 134 644	0,09
Shriram Transport Finance Co. Ltd., 4,4 %, 13/03/2024		5 825 000	5 801 117	0,26
Shriram Transport Finance Co. Ltd., 6,625 %, 22/04/2027		3 500 000	3 526 250	0,15
UPL Ltd., 4,625 %, 16/06/2030		1 005 000	861 995	0,04
			95 824 882	4,23
Indonésie				
Listrindo Capital B.V., 4,95 %, 14/09/2026		5 683 000	5 498 302	0,24
Medco Laurel Tree Pte. Ltd., 6,95 %, 12/11/2028		1 487 000	1 432 940	0,06
Medco Maple Tree Pte. Ltd., 8,96 %, 27/04/2029		4 729 000	4 841 314	0,21
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 2,8 %, 23/06/2030		2 124 000	1 893 765	0,08
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 4,7 %, 6/06/2032		2 417 000	2 380 145	0,10
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 3,398 %, 9/06/2031		5 270 000	4 527 756	0,20
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 4,805 %, 27/04/2052		4 204 000	3 342 180	0,15
PT Perusahaan Listrik Negara (République d'Indonésie), 4,875 %, 17/07/2049		2 720 000	2 296 006	0,10
République d'Indonésie, 3,55 %, 31/03/2032		3 890 000	3 538 936	0,16
République d'Indonésie, 4,65 %, 20/09/2032		3 471 000	3 410 642	0,15
République d'Indonésie, 4,85 %, 11/01/2033		6 529 000	6 529 706	0,29
République d'Indonésie, 1,1 %, 12/03/2033	EUR	4 147 000	3 529 310	0,16
République d'Indonésie, 4,35 %, 11/01/2048	USD	1 220 000	1 060 902	0,05
République d'Indonésie, 5,45 %, 20/09/2052		1 501 000	1 521 639	0,07
Star Energy Geothermal (Salak-Darajat) B.V., 4,85 %, 14/10/2038		1 010 000	927 291	0,04
Star Energy Geothermal (Wayang Windu) Ltd., 6,75 %, 24/04/2033		5 673 978	5 657 969	0,25
			52 388 803	2,31
Israël				
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III B.V., 7,875 %, 15/09/2029		3 561 000	3 840 948	0,17
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III B.V., 8,125 %, 15/09/2031		2 122 000	2 330 711	0,10
			6 171 659	0,27

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Jamaïque				
Gouvernement de Jamaïque, 7,875 %, 28/07/2045	USD	3 015 000	3 527 550	0,16
Jordan				
Royaume hachémite de Jordanie, 7,375 %, 10/10/2047		5 216 000	4 431 514	0,20
Kazakhstan				
Development Bank of Kazakhstan JSC, 2,95 %, 6/05/2031		1 273 000	1 057 099	0,05
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 5,375 %, 24/04/2030		1 602 000	1 568 598	0,07
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 3,5 %, 14/04/2033		7 959 000	6 510 621	0,29
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 5,75 %, 19/04/2047		6 299 000	5 461 863	0,24
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 6,375 %, 24/10/2048		18 813 000	17 309 691	0,77
KazTransGas JSC (République du Kazakhstan), 4,375 %, 26/09/2027		2 147 000	2 047 809	0,09
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 4 %, 15/08/2026		11 100 000	10 452 537	0,46
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 3,25 %, 15/08/2030		6 719 000	5 530 073	0,24
			49 938 291	2,21
Kenya				
République du Kenya, 7 %, 22/05/2027		707 000	648 743	0,03
République du Kenya, 8 %, 22/05/2032		8 396 000	7 385 592	0,32
			8 034 335	0,35
Koweït				
NBK SPC Ltd. (État du Koweït), 1,625 % jusqu'au 15/09/2026, FLR jusqu'au 15/09/2027		4 717 000	4 279 828	0,19
Macao				
Sands China Ltd., 3,25 %, 8/08/2031		5 388 000	4 475 870	0,20
Wynn Macau Ltd., 5,625 %, 26/08/2028		2 426 000	2 257 881	0,10
Wynn Macau Ltd., 5,125 %, 15/12/2029		3 718 000	3 307 672	0,14
			10 041 423	0,44
Malaisie				
Dua Capital Ltd. (Fédération de Malaisie), 2,78 %, 11/05/2031		5 316 000	4 604 177	0,20
PETRONAS Capital Ltd. (Fédération de Malaisie), 3,404 %, 28/04/2061		4 640 000	3 188 592	0,14
			7 792 769	0,34
Mexique				
Banco Mercantil del Norte S.A., 6,625 % jusqu'au 24/01/2032, FLR jusqu'au 24/01/2171		3 168 000	2 679 346	0,12
Banco Mercantil del Norte S.A., 7,625 % jusqu'au 10/01/2028, FLR jusqu'au 6/10/2171		2 860 000	2 792 075	0,12
BBVA Bancomer S.A. (Texas), 8,45 %, 29/06/2038		4 177 000	4 360 095	0,19
BBVA Bancomer S.A. (Texas), 8,125 %, 8/01/2039		3 450 000	3 509 944	0,16
Beclé S.A.B. de C.V., 2,5 %, 14/10/2031		2 800 000	2 200 800	0,10
Bimbo Bakeries USA, Inc., 6,05 %, 15/01/2029		1 626 000	1 695 951	0,07
Bimbo Bakeries USA, Inc., 6,05 %, 15/01/2029		3 802 000	3 980 017	0,18
Bimbo Bakeries USA, Inc., 5,375 %, 9/01/2036		5 946 000	5 995 709	0,27
Buffalo Energy Mexico Holdings, S.A. de C.V., 7,875 %, 15/02/2039		4 466 000	4 617 397	0,20
Comision Federal de Electricidad (États-Unis du Mexique), 4,688 %, 15/05/2029		4 670 000	4 406 314	0,19
Comision Federal de Electricidad (États-Unis du Mexique), 3,875 %, 26/07/2033		5 276 000	4 274 715	0,19
Electricidad Firme de Mexico Holdings S.A. de C.V., 4,9 %, 20/11/2026		5 093 000	4 697 816	0,21
GCC S.A.B. de C.V., 3,614 %, 20/04/2032		4 099 000	3 499 521	0,15
Grupo Axo S.A.P.I. de C.V., 5,75 %, 8/06/2026		4 574 000	4 273 893	0,19
Grupo KUO S.A.B. de C.V., 5,75 %, 7/07/2027		4 264 000	3 842 898	0,17
Infraestructura Energética Nova S.A.B. de C.V., 4,875 %, 14/01/2048		8 096 000	6 313 142	0,28
Petroleos Mexicanos, 6,49 %, 23/01/2027		3 563 000	3 349 392	0,15
Petroleos Mexicanos, 8,75 %, 2/06/2029		2 547 000	2 460 302	0,11
Petroleos Mexicanos, 6,84 %, 23/01/2030		8 275 000	7 105 238	0,31
Petroleos Mexicanos, 5,95 %, 28/01/2031		18 734 000	14 782 531	0,65
Petroleos Mexicanos, 6,7 %, 16/02/2032		12 588 000	10 277 856	0,45
Petroleos Mexicanos, 6,75 %, 21/09/2047		9 192 000	5 863 157	0,26
Petroleos Mexicanos, 7,69 %, 23/01/2050		24 089 000	16 840 793	0,74
Petroleos Mexicanos, 6,95 %, 28/01/2060		12 336 000	7 910 223	0,35
États-Unis du Mexique, 5,75 %, 5/03/2026	MXN	64 100 000	3 433 762	0,15
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 3/06/2027		83 200 000	4 575 360	0,20

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite			
Mexique, suite			
États-Unis du Mexique, 8,5 %, 31/05/2029	MXN 178 600 000	10 111 137	0,45
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031	141 500 000	7 599 310	0,34
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 26/05/2033	63 700 000	3 304 604	0,15
États-Unis du Mexique, 1,45 %, 25/10/2033	EUR 2 713 000	2 250 627	0,10
États-Unis du Mexique, 3,5 %, 12/02/2034	USD 5 714 000	4 782 606	0,21
États-Unis du Mexique, 6,35 %, 9/02/2035	2 155 000	2 240 970	0,10
États-Unis du Mexique, 8 %, 24/05/2035	MXN 41 100 000	2 156 308	0,10
États-Unis du Mexique, 6 %, 7/05/2036	USD 7 594 000	7 734 219	0,34
États-Unis du Mexique, 6,338 %, 4/05/2053	10 118 000	10 085 667	0,45
États-Unis du Mexique, 6,4 %, 7/05/2054	4 941 000	4 974 257	0,22
		194 977 952	8,62
Maroc			
Royaume du Maroc, 5,95 %, 8/03/2028	954 000	972 210	0,04
Royaume du Maroc, 3 %, 15/12/2032	3 864 000	3 100 860	0,14
Royaume du Maroc, 6,5 %, 8/09/2033	5 986 000	6 176 235	0,27
Office Cherifien des Phosphates S.A. (Royaume du Maroc), 5,125 %, 23/06/2051	4 092 000	2 947 959	0,13
		13 197 264	0,58
Nigeria			
République fédérale du Nigeria, 6,125 %, 28/09/2028	4 276 000	3 712 919	0,17
République fédérale du Nigeria, 7,875 %, 16/02/2032	12 231 000	10 603 299	0,47
République fédérale du Nigeria, 7,375 %, 28/09/2033	23 203 000	19 061 264	0,84
République fédérale du Nigeria, 7,696 %, 23/02/2038	12 724 000	10 007 680	0,44
République fédérale du Nigeria, 7,625 %, 28/11/2047	3 070 000	2 314 694	0,10
République fédérale du Nigeria, 9,248 %, 21/01/2049	300 000	263 250	0,01
République fédérale du Nigeria, 8,25 %, 28/09/2051	1 461 000	1 154 424	0,05
		47 117 530	2,08
Oman			
Oryx Funding Ltd. (Sultanat d'Oman), 5,8 %, 3/02/2031	7 420 000	7 355 075	0,33
Sultanat d'Oman, 6,5 %, 8/03/2047	11 310 000	11 151 434	0,49
Sultanat d'Oman, 6,75 %, 17/01/2048	31 239 000	31 379 700	1,39
Sultanat d'Oman, 7 %, 25/01/2051	31 368 000	32 390 722	1,43
		82 276 931	3,64
Pakistan			
République islamique du Pakistan, 6,875 %, 5/12/2027	7 749 000	5 628 874	0,25
République islamique du Pakistan, 7,375 %, 8/04/2031	8 443 000	5 485 417	0,24
		11 114 291	0,49
Panama			
Banco General S.A., 5,25 % jusqu'au 4/05/2031, FLR jusqu'au 7/05/2071	959 000	815 150	0,03
Empresa de Transmision Electrica S.A. (République du Panama), 5,125 %, 2/05/2049	4 105 000	2 945 337	0,13
Panama Canal Railway Co., 7 %, 1/11/2026	1 176 876	1 170 321	0,05
République du Panama, 3,362 %, 30/06/2031	2 449 000	1 894 302	0,08
République du Panama, 2,252 %, 29/09/2032	1 202 000	851 471	0,04
République du Panama, 3,298 %, 19/01/2033	945 000	725 556	0,03
République du Panama, 6,375 %, 25/07/2033	2 646 000	2 457 605	0,11
République du Panama, 6,4 %, 14/02/2035	3 069 000	2 895 342	0,13
République du Panama, 6,875 %, 31/01/2036	1 908 000	1 841 286	0,08
République du Panama, 6,853 %, 28/03/2054	4 224 000	3 775 494	0,17
République du Panama, 4,5 %, 19/01/2063	4 988 000	3 111 829	0,14
		22 483 693	0,99
Paraguay			
Banco Continental S.A.E.C.A., 2,75 %, 10/12/2025	2 070 000	1 936 538	0,08
République du Paraguay, 4,95 %, 28/04/2031	3 457 000	3 325 626	0,15
République du Paraguay, 3,849 %, 28/06/2033	8 516 000	7 373 448	0,33
République du Paraguay, 5,85 %, 21/08/2033	1 986 000	1 974 603	0,09
République du Paraguay, 5,6 %, 13/03/2048	13 119 000	11 675 690	0,52

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Paraguay, suite				
République du Paraguay, 5,4 %, 30/03/2050	USD	26 627 000	22 879 458	1,01
Teléfono Celular del Paraguay S.A., 5,875 %, 15/04/2027		4 292 000	4 161 512	0,18
			53 326 875	2,36
Pérou				
Hunt Oil Co. of Peru LLC, 8,55 %, 18/09/2033		3 344 000	3 561 417	0,16
IIRSA Norte Finance Ltd. (République du Pérou), 8,75 %, 30/05/2024		35 822	35 822	0,00
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030		3 425 000	2 819 518	0,13
San Miguel Industrias PET S.A., 3,5 %, 2/08/2028		6 330 000	5 475 450	0,24
			11 892 207	0,53
Philippines				
République des Philippines, 3,556 %, 29/09/2032		2 704 000	2 455 717	0,11
République des Philippines, 5,609 %, 13/04/2033		3 359 000	3 516 297	0,16
République des Philippines, 1,2 %, 28/04/2033	EUR	2 645 000	2 284 961	0,10
République des Philippines, 5 %, 17/07/2033	USD	2 216 000	2 240 095	0,10
République des Philippines, 1,75 %, 28/04/2041	EUR	2 221 000	1 672 244	0,07
			12 169 314	0,54
Pologne				
Bank Gospodarstwa Krajowego (République de Pologne), 6,25 %, 31/10/2028	USD	4 811 000	5 049 693	0,22
Bank Gospodarstwa Krajowego (République de Pologne), 5,375 %, 22/05/2033		3 362 000	3 373 196	0,15
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,875 %, 15/11/2029		2 417 000	2 130 126	0,09
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,875 %, 15/11/2029		4 794 000	4 225 000	0,19
République de Pologne, 3,625 %, 11/01/2034	EUR	2 918 000	3 169 818	0,14
Synthos S.A., 2,5 %, 7/06/2028		1 182 000	1 102 820	0,05
			19 050 653	0,84
Qatar				
Qatar Petroleum, 2,25 %, 12/07/2031	USD	2 073 000	1 732 663	0,08
Qatar Petroleum, 3,125 %, 12/07/2041		3 793 000	2 806 517	0,12
Qatar Petroleum, 3,3 %, 12/07/2051		4 275 000	2 970 697	0,13
QNB Finance Ltd. (État du Qatar), 2,75 %, 12/02/2027		4 076 000	3 807 098	0,17
État du Qatar, 4,817 %, 14/03/2049		11 198 000	10 414 140	0,46
			21 731 115	0,96
République de Moldavie				
Aragvi Finance International DAC, 8,45 %, 29/04/2026		5 729 000	4 090 506	0,18
Roumanie				
République de Roumanie, 5,25 %, 25/11/2027		6 204 000	6 143 139	0,27
République de Roumanie, 6,625 %, 17/02/2028		5 488 000	5 680 903	0,25
République de Roumanie, 5,5 %, 18/09/2028	EUR	6 821 000	7 588 914	0,34
République de Roumanie, 5,875 %, 30/01/2029	USD	3 776 000	3 820 953	0,17
République de Roumanie, 2,124 %, 16/07/2031	EUR	2 439 000	2 126 417	0,09
République de Roumanie, 2 %, 28/01/2032		5 014 000	4 286 917	0,19
République de Roumanie, 3,625 %, 27/03/2032	USD	2 064 000	1 784 138	0,08
République de Roumanie, 7,125 %, 17/01/2033		7 000 000	7 550 480	0,33
République de Roumanie, 6,375 %, 30/01/2034		3 544 000	3 630 580	0,16
République de Roumanie, 6 %, 25/05/2034		2 172 000	2 168 925	0,10
République de Roumanie, 2,75 %, 14/04/2041	EUR	3 410 000	2 469 076	0,11
			47 250 442	2,09
Arabie saoudite				
BSF Finance, 5,5 %, 23/11/2027	USD	4 250 000	4 297 813	0,19
GACI First Investment Co. (Royaume d'Arabie Saoudite), 4,875 %, 14/02/2035		3 324 000	3 157 800	0,14
GACI First Investment Co. (Royaume d'Arabie Saoudite), 5,375 %, 29/01/2054		5 800 000	5 046 000	0,22
Royaume d'Arabie Saoudite, 5 %, 16/01/2034		9 197 000	9 162 364	0,41
Royaume d'Arabie Saoudite, 4,625 %, 4/10/2047		14 266 000	12 286 592	0,54
Royaume d'Arabie Saoudite, 5 %, 18/01/2053		11 489 000	10 196 488	0,45
Royaume d'Arabie Saoudite, 5,75 %, 16/01/2054		9 399 000	9 236 491	0,41
Royaume d'Arabie Saoudite, 3,75 %, 21/01/2055		2 923 000	2 075 330	0,09

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Arabie saoudite, suite				
SA Global Sukuk Ltd. (Royaume d'Arabie Saoudite), 2,694 %, 17/06/2031	USD	2 316 000	1 999 607	0,09
Saudi Arabian Oil Co., 3,5 %, 16/04/2029		2 838 000	2 646 435	0,12
Saudi Arabian Oil Co., 2,25 %, 24/11/2030		6 002 000	5 050 899	0,22
Saudi Arabian Oil Co., 4,25 %, 16/04/2039		1 345 000	1 161 733	0,05
Saudi Aramco (Royaume d'Arabie Saoudite), 4,5 %, 26/10/2046		11 667 000	9 916 950	0,44
			76 234 502	3,37
Sénégal				
République du Sénégal, 6,75 %, 13/03/2048		7 454 000	5 581 719	0,25
Serbie				
République de Serbie, 6,25 %, 26/05/2028		4 291 000	4 370 083	0,19
République de Serbie, 1,5 %, 26/06/2029	EUR	2 393 000	2 169 104	0,10
République de Serbie, 6,5 %, 26/09/2033	USD	3 217 000	3 279 217	0,14
			9 818 404	0,43
Singapour				
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 1,832 % jusqu'au 10/09/2025, FLR jusqu'au 10/09/2030		1 615 000	1 526 264	0,07
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd., 4,602 % jusqu'au 15/06/2027, FLR jusqu'au 15/06/2032		3 284 000	3 227 121	0,14
Puma International Financing S.A., 5 %, 24/01/2026		7 587 000	7 186 103	0,32
United Overseas Bank Ltd., 2 % jusqu'au 14/10/2026, FLR jusqu'au 14/10/2031		6 332 000	5 799 264	0,26
United Overseas Bank Ltd., 3,863 % jusqu'au 7/10/2027, FLR jusqu'au 7/10/2032		3 348 000	3 191 060	0,14
Vena Energy Capital Pte Ltd., 3,133 %, 26/02/2025		5 650 000	5 484 013	0,24
			26 413 825	1,17
Slovaquie				
Eustream A.S. (République slovaque), 1,625 %, 25/06/2027	EUR	4 142 000	3 771 249	0,17
Slovénie				
United Group B.V., 3,625 %, 15/02/2028		2 142 000	2 118 652	0,09
United Group B.V., 6,75 %, 15/02/2031		3 131 000	3 368 683	0,15
			5 487 335	0,24
Afrique du Sud				
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 7,125 %, 11/02/2025	USD	11 344 000	11 286 599	0,50
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 6,35 %, 10/08/2028		4 819 000	4 668 310	0,21
Petra Diamonds US\$ Treasury PLC, 9,75 %, 8/03/2026 (p)		3 514 427	2 846 686	0,12
République d'Afrique du Sud, 5,75 %, 30/09/2049		16 856 000	12 466 698	0,55
République d'Afrique du Sud, 7,3 %, 20/04/2052		4 083 000	3 602 839	0,16
Sasol Financing (USA) LLC, 5,5 %, 18/03/2031		9 055 000	7 601 752	0,34
			42 472 884	1,88
Corée du Sud				
République de Corée, 3,25 %, 10/03/2028	KRW	7 366 890 000	5 520 296	0,24
SK hynix, Inc., 6,25 %, 17/01/2026	USD	1 976 000	1 999 449	0,09
SK hynix, Inc., 6,375 %, 17/01/2028		1 274 000	1 323 875	0,06
SK hynix, Inc., 2,375 %, 19/01/2031		2 771 000	2 292 473	0,10
SK hynix, Inc., 5,5 %, 16/01/2027		2 511 000	2 521 848	0,11
SK hynix, Inc., 5,5 %, 16/01/2029		4 351 000	4 398 367	0,20
			18 056 308	0,80
Sri Lanka				
République du Sri Lanka, 6,2 %, 11/05/2027 (d)		2 191 000	1 114 363	0,05
République du Sri Lanka, 6,75 %, 18/04/2028 (d)		5 887 000	3 004 798	0,13
République du Sri Lanka, 7,85 %, 14/03/2029 (d)		9 728 000	4 913 731	0,22
République du Sri Lanka, 7,55 %, 28/03/2030 (d)		26 651 000	13 453 666	0,59
			22 486 558	0,99
Thaïlande				
Bangkok Bank Public Co. Ltd., 5,5 %, 21/09/2033		5 454 000	5 544 427	0,24
Bangkok Bank Public Co. Ltd., 3,733 % jusqu'au 25/09/2029, FLR jusqu'au 25/09/2034		2 527 000	2 243 865	0,10
Kasikornbank PLC (Hong Kong Branch), 3,343 %, 2/10/2031		2 383 000	2 205 967	0,10
			9 994 259	0,44

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Turquie				
République turque, 5,6 %, 14/11/2024	USD	1 676 000	1 669 715	0,07
République turque, 4,25 %, 13/03/2025		5 980 000	5 837 855	0,26
République turque, 4,75 %, 26/01/2026		1 379 000	1 332 803	0,06
République turque, 4,875 %, 9/10/2026		7 708 000	7 361 140	0,33
République turque, 5,125 %, 17/02/2028		6 649 000	6 176 588	0,27
République turque, 6,125 %, 24/10/2028		1 841 000	1 765 059	0,08
République turque, 8,509 %, 14/01/2029		4 999 000	5 179 164	0,23
République turque, 5,25 %, 13/03/2030		10 655 000	9 429 675	0,42
République turque, 5,95 %, 15/01/2031		8 279 000	7 500 443	0,33
République turque, 5,875 %, 26/06/2031		15 580 000	13 980 869	0,62
République turque, 9,375 %, 19/01/2033		2 091 000	2 271 474	0,10
République turque, 6,875 %, 17/03/2036		9 452 000	8 588 182	0,38
République turque, 6 %, 14/01/2041		14 005 000	11 149 801	0,49
République turque, 5,75 %, 11/05/2047		17 868 000	13 007 189	0,57
Türkiye İhracat Kredi Bankası A.S. (République turque), 9 %, 28/01/2027		2 144 000	2 219 040	0,10
Türkiye İhracat Kredi Bankası A.S. (République turque), 7,5 %, 6/02/2028		6 855 000	6 794 882	0,30
			104 263 879	4,61
Ukraine				
Gouvernement d'Ukraine, 7,75 %, 1/09/2029 (p)		1 821 000	451 608	0,02
Gouvernement d'Ukraine, 6,876 %, 21/05/2031 (p)		8 921 000	1 940 317	0,08
Gouvernement d'Ukraine, 7,375 %, 25/09/2034 (p)		15 670 000	3 541 420	0,16
Gouvernement d'Ukraine, 7,253 %, 15/03/2035 (p)		16 668 000	3 771 135	0,17
Gouvernement d'Ukraine, GDP Linked Bond, 0 %, 1/08/2041		9 370 000	4 272 251	0,19
NPC Ukrenergo (Gouvernement d'Ukraine), 6,875 %, 9/11/2028		3 863 000	1 075 846	0,05
Ukrainian Railways, 8,25 %, 9/07/2026		5 674 000	3 262 550	0,14
Ukrainian Railways, 7,875 %, 15/07/2028		3 568 000	1 873 200	0,08
			20 188 327	0,89
Émirats arabes unis				
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC, 3,5 %, 31/03/2027		4 048 000	3 851 842	0,17
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline, 4,6 %, 2/11/2047		7 580 000	6 727 250	0,30
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC, 4,696 %, 24/04/2033		3 230 000	3 181 950	0,14
DAE Funding LLC (Émirats arabes unis), 3,375 %, 20/03/2028		3 574 000	3 274 999	0,15
DAE Sukuk (DIFC) Ltd., 3,75 %, 15/02/2026		4 294 000	4 111 247	0,18
Emirates NBD Bank PJSC (Émirats arabes unis), 5,875 %, 11/10/2028		3 166 000	3 273 182	0,14
Emirates Sembcorp Water & Power Co. (Émirats arabes unis), 4,45 %, 1/08/2035		2 282 000	2 146 677	0,10
First Abu Dhabi Bank PJSC, 6,32 % jusqu'au 4/04/2031, FLR jusqu'au 4/04/2034		7 510 000	7 711 809	0,34
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,625 %, 31/03/2036		5 530 000	4 491 006	0,20
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,94 %, 30/09/2040		7 439 766	5 955 831	0,26
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 3,25 %, 30/09/2040		2 884 000	2 189 930	0,10
MDGH - GMTN RSC Ltd. (Émirats arabes unis), 5,5 %, 28/04/2033		3 690 000	3 821 851	0,17
National Central Cooling Co., PJSC (Émirats arabes unis), 2,5 %, 21/10/2027		2 331 000	2 097 280	0,09
Sweihan PV Power Co. PJSC (Émirats arabes unis), 3,625 %, 31/01/2049		6 959 314	5 495 395	0,24
			58 330 249	2,58
États-Unis				
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3,625 %, 15/01/2032		5 327 000	4 534 651	0,20
JBS USA LUX S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 5,75 %, 1/04/2033		3 444 000	3 409 762	0,15
Obligations du Trésor américain, 3,5 %, 15/02/2039		11 157 000	10 421 771	0,46
Obligations du Trésor américain, 2,5 %, 15/02/2046 (g)		32 008 200	23 564 787	1,04
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 30/09/2029		3 342 000	3 334 950	0,15
Bons du Trésor américain, 2,75 %, 15/08/2032		7 625 000	6 965 855	0,31
			52 231 776	2,31
Uruguay				
République orientale d'Uruguay, 8,5 %, 15/03/2028	UYU	127 935 000	3 177 565	0,14
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031		98 005 000	2 357 675	0,10
République orientale d'Uruguay, 9,75 %, 20/07/2033		237 888 000	6 262 925	0,28

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Uruguay, suite				
République orientale d'Uruguay, 5,75 %, 28/10/2034	USD	5 724 000	6 115 620	0,27
République orientale d'Uruguay, 4,975 %, 20/04/2055		6 849 000	6 457 562	0,29
République orientale d'Uruguay, Obligation indexée sur l'inflation, 3,875 %, 2/07/2040	UYU	82 919 403	2 252 757	0,10
			26 624 104	1,18
Ouzbékistan				
Ipoteka Bank (République d'Ouzbékistan), 5,5 %, 19/11/2025	USD	1 785 000	1 682 184	0,07
National Bank of Uzbekistan, 4,85 %, 21/10/2025		4 357 000	4 116 929	0,18
République d'Ouzbékistan, 7,85 %, 12/10/2028		4 338 000	4 496 771	0,20
République d'Ouzbékistan, 5,375 %, 20/02/2029		4 621 000	4 303 306	0,19
République d'Ouzbékistan, 3,7 %, 25/11/2030		2 965 000	2 423 888	0,11
République d'Ouzbékistan, 3,9 %, 19/10/2031		5 376 000	4 356 925	0,19
Uzbekneftegaz JSC (République d'Ouzbékistan), 4,75 %, 16/11/2028		4 615 000	3 843 058	0,17
			25 223 061	1,11
Venezuela				
République du Venezuela, 9 %, 7/05/2023 (d)		4 486 000	627 326	0,03
République du Venezuela, 8,25 %, 13/10/2024 (d)		7 913 000	1 110 263	0,05
République du Venezuela, 7,65 %, 21/04/2025 (d)		11 400 000	1 623 758	0,07
République du Venezuela, 9,25 %, 15/09/2027 (d)		13 576 000	2 404 413	0,11
République du Venezuela, 9,375 %, 13/01/2034 (d)		422 000	72 355	0,00
République du Venezuela, 7 %, 31/03/2038 (d)		25 230 500	3 675 640	0,16
			9 513 755	0,42
Vietnam				
Mong Duong Finance Holdings B.V., 5,125 %, 7/05/2029		6 219 926	5 829 875	0,26
République socialiste du Vietnam, 4,8 %, 19/11/2024		12 497 000	12 359 532	0,54
			18 189 407	0,80
Zambie				
République de Zambie, 8,97 %, 30/07/2027 (d)		19 056 000	11 948 112	0,53
Total des obligations (coût identifié, 2 219 561 665 \$)			2 071 419 224	91,53
ACTIONS ORDINAIRES				
Royaume-Uni				
Petra Diamonds Ltd. (coût identifié, 1 132 891 \$)		1 280 103	876 028	0,04
OBLIGATIONS CONVERTIBLES				
Chine				
Sunac China Holdings Ltd., 0 %, 30/09/2028 (coût identifié, 6 925 578 \$)	USD	6 375 107	1 275 021	0,06
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 15 185 000 \$)	USD	15 185 000	15 182 807	0,67
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 242 805 134 \$)			2 088 753 080	92,30
Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats	
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
MSCI Emerging Markets Index – Septembre 2024 @ 880 \$		21 174 831	217	447 020
MSCI Emerging Markets Index – Juin 2024 @ 850 \$		17 564 376	180	145 800
Total des options de vente achetées (primes versées, 1 373 191 \$)				592 820
Total des investissements (coût identifié, 2 244 178 325 \$)			2 089 345 900	92,33
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			173 628 099	7,67
ACTIF NET			2 262 973 999	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Local Currency Fund

(en dollars US)

Nom du titre

Valeurs mobilières et instruments du marché
monétaire négociés sur un marché réglementé

		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Brésil				
République fédérative du Brésil, 0 %, 1/01/2026	BRL	7 785 000	1 314 481	4,61
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2027		10 407 000	2 106 482	7,39
			3 420 963	12,00
Chili				
République du Chili, 2,5 %, 1/03/2025	CLP	280 000 000	291 460	1,02
République du Chili, 5 %, 1/10/2028		485 000 000	523 988	1,84
République du Chili, 4,7 %, 1/09/2030		190 000 000	197 768	0,69
République du Chili, Obligation indexée sur l'inflation, 3,4 %, 1/10/2039		110 181 300	133 286	0,47
			1 146 502	4,02
Chine				
China Development Bank, 3,45 %, 20/09/2029	CNY	2 170 000	316 979	1,11
République populaire de Chine, 2,75 %, 17/02/2032		1 350 000	191 343	0,67
République populaire de Chine, 2,88 %, 25/02/2033		5 350 000	769 164	2,70
			1 277 486	4,48
Colombie				
Empresas Publicas de Medellin, 8,375 %, 8/11/2027	COP	486 000 000	108 218	0,38
République de Colombie, 7,5 %, 26/08/2026		1 348 900 000	335 725	1,18
République de Colombie, 5,75 %, 3/11/2027		4 785 600 000	1 109 935	3,89
République de Colombie, 7,25 %, 18/10/2034		1 777 900 000	386 899	1,36
République de Colombie, "B", 7,75 %, 18/09/2030		2 154 200 000	518 058	1,81
			2 458 835	8,62
République tchèque				
République tchèque, 2,5 %, 25/08/2028	CZK	16 260 000	674 043	2,36
République tchèque, 2,75 %, 23/07/2029		2 670 000	111 008	0,39
République tchèque, 2 %, 13/10/2033		13 520 000	502 559	1,76
EPH Financing International A.S., 6,651 %, 13/11/2028	EUR	100 000	110 428	0,39
PPF Telecom Group B.V., 3,25 %, 29/09/2027		100 000	104 786	0,37
			1 502 824	5,27
République dominicaine				
République dominicaine, 13,625 %, 3/02/2033	DOP	8 000 000	164 939	0,58
Guatemala				
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029	USD	32 000	29 892	0,10
Hongrie				
République de Hongrie, 4,5 %, 23/03/2028	HUF	241 660 000	648 003	2,27
République de Hongrie, 2,25 %, 20/04/2033		185 280 000	388 331	1,36
République de Hongrie, 2,25 %, 22/06/2034		148 380 000	301 863	1,06
			1 338 197	4,69
Inde				
République de l'Inde, 7,18 %, 14/08/2033	INR	11 580 000	139 286	0,49
Shriram Transport Finance Co. Ltd., 4,4 %, 13/03/2024	USD	200 000	199 180	0,70
			338 466	1,19
Indonésie				
République d'Indonésie, 6,375 %, 15/08/2028	IDR	12 534 000 000	792 843	2,78
République d'Indonésie, 9 %, 15/03/2029		2 006 000 000	140 674	0,49
République d'Indonésie, 7 %, 15/09/2030		6 898 000 000	446 871	1,57
République d'Indonésie, 6,375 %, 15/04/2032		3 523 000 000	219 893	0,77
République d'Indonésie, 7,5 %, 15/08/2032		5 575 000 000	372 557	1,31
République d'Indonésie, 8,375 %, 15/04/2039		4 532 000 000	328 176	1,15
République d'Indonésie, 7,125 %, 15/06/2043		315 000 000	20 478	0,07
			2 321 492	8,14
Jamaïque				
Gouvernement de Jamaïque, 9,625 %, 3/11/2030	JMD	10 000 000	67 491	0,24
Malaisie				
Gouvernement de Malaisie, 3,733 %, 15/06/2028	MYR	524 000	111 325	0,39
Gouvernement de Malaisie, 4,232 %, 30/06/2031		1 695 000	369 284	1,30

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Local Currency Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Malaisie, suite				
Gouvernement de Malaisie, 3,582 %, 15/07/2032	MYR	1 312 000	271 846	0,95
Gouvernement de Malaisie, 3,757 %, 22/05/2040		912 000	185 227	0,65
Gouvernement de Malaisie, 4,065 %, 15/06/2050		1 121 000	232 050	0,81
			1 169 732	4,10
Mexique				
Buffalo Energy Mexico Holdings, S.A. de C.V., 7,875 %, 15/02/2039	USD	200 000	206 780	0,72
Petroleos Mexicanos, 7,47 %, 12/11/2026	MXN	1 985 300	100 791	0,35
Red de Carreteras de Occidente SAPIB de C.V., 9 %, 10/06/2028		1 568 700	85 194	0,30
États-Unis du Mexique, 5 %, 6/03/2025		400 000	22 015	0,08
États-Unis du Mexique, 5,75 %, 5/03/2026		5 100 000	273 201	0,96
États-Unis du Mexique, 8,5 %, 31/05/2029		15 500 000	877 507	3,08
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031		17 500 000	939 844	3,29
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 26/05/2033		4 500 000	233 449	0,82
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 23/11/2034		11 700 000	610 203	2,14
			3 348 984	11,74
Pérou				
Banco de Credito del Peru, 4,65 %, 17/09/2024	PEN	686 000	177 115	0,62
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030	USD	200 000	164 643	0,58
République du Pérou, 6,95 %, 12/08/2031	PEN	1 506 000	413 142	1,45
			754 900	2,65
Philippines				
République des Philippines, 6,875 %, 10/01/2029	PHP	9 000 000	164 719	0,58
Pologne				
République de Pologne, 2,75 %, 25/04/2028	PLN	763 000	175 101	0,61
République de Pologne, 1,25 %, 25/10/2030		1 352 000	266 704	0,94
République de Pologne, 1,75 %, 25/04/2032		949 000	184 275	0,65
			626 080	2,20
Roumanie				
République de Roumanie, 4,75 %, 24/02/2025	RON	2 925 000	627 670	2,20
République de Roumanie, 8,75 %, 30/10/2028		805 000	192 527	0,67
République de Roumanie, 7,125 %, 17/01/2033	USD	76 000	81 977	0,29
République de Roumanie, 4,25 %, 28/04/2036	RON	1 965 000	351 006	1,23
			1 253 180	4,39
Slovénie				
United Group B.V., 6,75 %, 15/02/2031	EUR	100 000	107 591	0,38
Afrique du Sud				
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 7,85 %, 2/04/2026	ZAR	2 000 000	103 307	0,36
République d'Afrique du Sud, 7 %, 28/02/2031		5 240 000	234 845	0,82
République d'Afrique du Sud, 8,875 %, 28/02/2035		12 005 000	540 089	1,89
République d'Afrique du Sud, 9 %, 31/01/2040		17 706 000	735 665	2,58
Transnet SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 13,5 %, 18/04/2028		1 700 000	95 425	0,34
			1 709 331	5,99
Sri Lanka				
République du Sri Lanka, 6,75 %, 18/04/2028 (d)	USD	200 000	102 083	0,36
Thaïlande				
Royaume de Thaïlande, 3,775 %, 25/06/2032	THB	24 291 000	743 615	2,61
Royaume de Thaïlande, 1,6 %, 17/06/2035		8 359 000	209 569	0,74
Royaume de Thaïlande, 3,3 %, 17/06/2038		4 390 000	129 287	0,45
Royaume de Thaïlande, 2 %, 17/06/2042		3 056 000	73 919	0,26
			1 156 390	4,06
Uruguay				
République orientale d'Uruguay, 8,5 %, 15/03/2028	UYU	14 721 000	365 631	1,28
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031		3 501 000	84 222	0,29

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Debt Local Currency Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Uruguay, suite				
République orientale d'Uruguay, 9,75 %, 20/07/2033	UYU	2 892 000	76 138	0,27
			525 991	1,84
Total des obligations (coût identifié, 25 489 136 \$)			24 986 068	87,62
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 238 000 \$)	USD	238 000	237 966	0,83
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 25 727 136 \$)			25 224 034	88,45
Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats	
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
MSCI Emerging Markets Index – Juin 2024 @ 900 \$		292 740	3	4 650
MSCI Emerging Markets Index – Septembre 2024 @ 850 \$		195 160	2	3 100
Total des options de vente achetées (primes versées, 15 335 \$)			7 750	0,03
Total des investissements (coût identifié, 25 742 471 \$)			25 231 784	88,48
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			3 284 263	11,52
ACTIF NET			28 516 047	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES				
Boissons alcoolisées				
Ambev S.A., ADR		365 133	956 649	1,22
China Resources Beer Holdings Co. Ltd.		130 000	468 089	0,60
Kweichow Moutai Co. Ltd., "A"		4 960	1 102 751	1,40
Wuliangye Yibin Co. Ltd., "A"		29 800	522 092	0,66
			3 049 581	3,88
Industrie automobile				
BYD Co. Ltd.		22 000	490 487	0,62
Hero MotoCorp Ltd.		7 914	437 977	0,56
Mahindra & Mahindra Ltd.		55 531	1 099 570	1,40
			2 028 034	2,58
Biotechnologies				
Hugel, Inc.		5 247	597 568	0,76
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
B3 S.A. - Brasil Bolsa Balcao		216 100	570 957	0,73
Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC (c)		808 503	0	0,00
			570 957	0,73
Services aux entreprises				
Infosys Ltd.		83 231	1 661 309	2,11
Tata Consultancy Services Ltd.		34 304	1 576 306	2,01
Tech Mahindra Ltd.		49 552	789 933	1,01
			4 027 548	5,13
Produits chimiques				
UPL Ltd.		157 117	1 014 336	1,29
Logiciels				
Kingsoft Corp.		181 800	440 434	0,56

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels - Systèmes			
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	388 000	1 265 566	1,61
Samsung Electronics Co. Ltd.	90 611	4 913 357	6,26
		6 178 923	7,87
Conglomérats			
LG Corp.	8 778	536 088	0,68
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	181 500	364 024	0,46
Gree Electric Appliances, Inc., "A"	193 800	952 315	1,21
Midea Group Co. Ltd., "A"	79 300	643 386	0,82
Techtronic Industries Co. Ltd.	88 000	940 107	1,20
Zhejiang Supor Co. Ltd., "A"	22 912	161 639	0,21
		3 061 471	3,90
Biens de consommation			
AmorePacific Corp.	1 908	166 862	0,21
Électronique			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	375 330	7 518 993	9,57
Énergie - Sociétés indépendantes			
Reliance Industries Ltd.	20 892	715 629	0,91
Énergie - Sociétés intégrées			
China Petroleum & Chemical Corp.	634 000	329 247	0,42
Galp Energia SGPS S.A., "B"	75 185	1 179 135	1,50
LUKOIL PJSC (c)	14 635	0	0,00
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	67 218	1 147 411	1,46
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	35 083	575 361	0,73
Petronet LNG Ltd.	58 158	187 685	0,24
		3 418 839	4,35
Ingénierie - Construction			
Doosan Bobcat, Inc.	20 397	767 168	0,98
Alimentation et boissons			
Gruma S.A.B. de C.V.	43 818	820 275	1,05
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd., "A"	349 400	1 314 116	1,67
Orion Corp.	6 499	442 482	0,56
Tingyi (Îles Caïmans) Holding Corp.	268 000	266 013	0,34
		2 842 886	3,62
Magasins d'alimentation et pharmacies			
BIM Birlesik Magazalar A.S.	21 237	266 644	0,34
Produits forestiers et papier			
Suzano S.A.	52 000	541 789	0,69
Assurances			
AIA Group Ltd.	80 000	622 044	0,79
DB Insurance Co. Ltd.	8 905	582 661	0,74
Discovery Ltd.	49 918	369 349	0,47
Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd.	20 142	509 310	0,65
Ping An Insurance Co. of China Ltd., "H"	328 000	1 384 046	1,77
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	5 777	1 139 275	1,45
		4 606 685	5,87
Internet			
Baidu, Inc., ADR	1 945	204 828	0,26
MakeMyTrip Ltd.	7 065	391 330	0,50
NAVER Corp.	2 746	406 039	0,52
NetEase, Inc., ADR	11 108	1 084 585	1,38
Tencent Holdings Ltd.	105 300	3 662 342	4,66
		5 749 124	7,32
Machines et outils			
Delta Electronics, Inc.	135 000	1 200 426	1,53

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Grandes banques			
Banco Bradesco S.A., ADR	329 645	1 021 900	1,30
Bandhan Bank Ltd.	200 726	550 461	0,70
Erste Group Bank AG	25 288	1 094 516	1,39
Nedbank Group Ltd.	50 499	586 649	0,75
		3 253 526	4,14
Technologies et services médicaux et de santé			
Burning Rock Biotech Ltd., ADR	39 004	33 544	0,04
Métaux et exploitation minière			
Industries Qatar Q.P.S.C.	54 207	178 656	0,23
PT United Tractors Tbk	590 100	858 225	1,09
Vale S.A., ADR	38 342	524 902	0,67
		1 561 783	1,99
Gaz naturel - Distribution			
China Resources Gas Group Ltd.	162 400	459 077	0,58
Réseaux et télécommunications			
GDS Holdings Ltd., "A"	53 900	35 966	0,04
GDS Holdings Ltd., ADR	17 320	93 874	0,12
		129 840	0,16
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Bangkok Bank Public Co. Ltd.	203 000	801 071	1,02
Bank Negara Indonesia PT	1 867 700	680 562	0,87
China Construction Bank Corp.	2 148 750	1 273 600	1,62
China Merchants Bank Co. Ltd.	50 000	182 214	0,23
China Merchants Bank Co. Ltd. "A"	68 600	293 854	0,37
Credicorp Ltd.	8 099	1 202 135	1,53
Emirates NBD Bank PJSC	143 413	691 109	0,88
Grupo Financiero Banorte S.A. de C.V.	27 710	281 841	0,36
HDFC Bank Ltd.	88 249	1 544 718	1,97
IndusInd Bank Ltd.	23 832	438 527	0,56
KB Financial Group, Inc.	19 119	810 801	1,03
Kotak Mahindra Bank Ltd.	63 434	1 389 417	1,77
Sberbank of Russia PJSC (c)	630 893	0	0,00
SK Square Co. Ltd.	6 423	248 231	0,32
Tisco Financial Group PCL	216 800	604 981	0,77
		10 443 061	13,30
Produits pharmaceutiques			
Genomma Lab Internacional S.A., "B"	278 066	228 120	0,29
Métaux et minéraux précieux			
Gold Fields Ltd., ADR	57 749	854 685	1,09
Polymetal International PLC	77 528	296 157	0,38
		1 150 842	1,47
Immobilier			
Emaar Properties PJSC	526 449	1 066 141	1,36
ESR Group Ltd.	160 400	204 758	0,26
Hang Lung Properties Ltd.	301 000	348 094	0,44
SM Investments Corp.	10 590	169 305	0,22
		1 788 298	2,28
Restaurants			
Yum China Holdings, Inc.	26 449	914 871	1,16
Produits chimiques spéciaux			
Saudi Basic Industries Corp.	16 959	352 286	0,45
Magasins spécialisés			
Alibaba Group Holding Ltd.	255 736	2 295 598	2,92
JD.com, Inc., "A"	21 088	236 575	0,30
JD.com, Inc., ADR	1 309	29 518	0,04

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Magasins spécialisés, suite			
Lojas Renner S.A.	53 652	173 808	0,22
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios S.A.	50 956	286 540	0,37
Vipshop Holdings Ltd., ADR	37 796	600 579	0,77
Walmart de Mexico S.A.B. de C.V.	274 390	1 133 653	1,44
		4 756 271	6,06
Télécommunications mobiles			
Advanced Info Service Public Co. Ltd.	75 500	463 928	0,59
Etihad Etisalat Co.	52 585	730 561	0,93
PT Telekom Indonesia	3 256 000	817 095	1,04
		2 011 584	2,56
Services téléphoniques			
Hellenic Telecommunications Organization S.A.	39 710	551 453	0,70
Tabac			
British American Tobacco PLC	24 633	727 396	0,93
Total des actions ordinaires (coût identifié, 87 462 523 \$)		77 661 937	98,88
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)			
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 115 000 \$)	USD 115 000	114 984	0,15
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 87 577 523 \$) (k)		77 776 921	99,03
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		760 603	0,97
ACTIF NET		78 537 524	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Research Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Compagnies aériennes			
Grupo Aeroportuario del Sureste, "B"	1 188	34 631	1,24
Boissons alcoolisées			
Ambev S.A.	9 200	24 289	0,87
China Resources Beer Holdings Co. Ltd.	8 000	28 805	1,03
Kweichow Moutai Co. Ltd., "A"	200	44 466	1,59
		97 560	3,49
Industrie automobile			
BYD Co. Ltd.	2 000	44 590	1,60
Mahindra & Mahindra Ltd.	2 522	49 938	1,79
		94 528	3,39
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
B3 S.A. - Brasil Bolsa Balcao	14 700	38 839	1,39
Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC (c)	16 286	0	0,00
		38 839	1,39
Services aux entreprises			
Infosys Ltd.	1 313	26 208	0,94
Tata Consultancy Services Ltd.	899	41 310	1,48
		67 518	2,42
Produits chimiques			
UPL Ltd.	6 387	41 234	1,48
Logiciels			
Kingsoft Corp.	9 800	23 742	0,85

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels - Systèmes			
Samsung Electronics Co. Ltd.	4 212	228 395	8,18
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	13 000	26 073	0,93
Midea Group Co. Ltd., "A"	6 900	55 982	2,01
Techtronic Industries Co. Ltd.	6 000	64 098	2,30
		146 153	5,24
Biens de consommation			
AmorePacific Corp.	282	24 662	0,88
Services de consommation			
Localiza Rent a Car S.A.	4 033	44 055	1,58
Électronique			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	13 000	260 429	9,33
Énergie - Sociétés indépendantes			
Reliance Industries Ltd.	2 744	93 992	3,37
Énergie - Sociétés intégrées			
Galp Energia SGPS S.A., "B"	3 910	61 321	2,20
LUKOIL PJSC (c)	486	0	0,00
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	1 651	28 182	1,01
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	1 572	25 781	0,92
		115 284	4,13
Ingénierie - Construction			
Doosan Bobcat, Inc.	793	29 826	1,07
Alimentation et boissons			
Gruma S.A.B. de C.V.	3 321	62 169	2,23
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co. Ltd., "A"	10 600	39 867	1,43
		102 036	3,66
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Jeronimo Martins SGPS S.A.	976	22 234	0,80
Produits forestiers et papier			
Suzano S.A.	2 800	29 173	1,04
Jeux et hôtellerie			
Sands China Ltd.	6 400	16 782	0,60
Assurances			
AIA Group Ltd.	5 200	40 433	1,45
Ping An Insurance Co. of China Ltd., "H"	8 500	35 867	1,28
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	110	21 693	0,78
		97 993	3,51
Internet			
NetEase, Inc., ADR	414	40 423	1,45
Tencent Holdings Ltd.	2 500	86 950	3,11
		127 373	4,56
Grandes banques			
Banco Bradesco S.A., ADR	10 459	32 423	1,16
Bandhan Bank Ltd.	14 413	39 526	1,42
Erste Group Bank AG	1 029	44 537	1,59
National Bank of Greece S.A.	3 889	29 546	1,06
		146 032	5,23
Équipements médicaux			
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd., "A"	600	22 424	0,80
Métaux et exploitation minière			
Industries Qatar Q.P.S.C.	11 928	39 312	1,41
PT United Tractors Tbk	29 000	42 177	1,51
Vale S.A., ADR	2 277	31 172	1,12
		112 661	4,04

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Emerging Markets Equity Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Gaz naturel - Distribution			
China Resources Gas Group Ltd.	14 000	39 576	1,42
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Bank Negara Indonesia PT	180 200	65 662	2,35
China Merchants Bank Co. Ltd.	9 000	32 799	1,18
Credicorp Ltd.	242	35 920	1,29
Emirates NBD Bank PJSC	7 042	33 935	1,22
HDFC Bank Ltd.	2 414	42 255	1,51
IndusInd Bank Ltd.	1 928	35 477	1,27
Kasikornbank Co. Ltd.	6 600	22 138	0,79
KB Financial Group, Inc.	1 113	47 200	1,69
Kotak Mahindra Bank Ltd.	2 705	59 249	2,12
Sberbank of Russia PJSC (c)	11 518	0	0,00
		374 635	13,42
Produits pharmaceutiques			
Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	962	16 432	0,59
Métaux et minéraux précieux			
Gold Fields Ltd., ADR	1 703	25 204	0,90
Polymetal International PLC	3 475	13 275	0,48
		38 479	1,38
Restaurants			
Yum China Holdings, Inc.	1 583	54 756	1,96
Magasins spécialisés PDD Holdings, Inc., ADR	290	36 793	1,32
Walmart de Mexico S.A.B. de C.V.	12 333	50 954	1,82
		87 747	3,14
Télécommunications mobiles			
Advanced Info Service Public Co. Ltd.	8 100	49 772	1,78
Etihad Etisalat Co.	1 369	19 020	0,68
		68 792	2,46
Services téléphoniques			
Hellenic Telecommunications Organization S.A.	3 733	51 840	1,86
Total des actions ordinaires (coût identifié, 3 155 780 \$)		2 749 813	98,51

	Prix d'exercice	Premier exercice			
DROITS					
Services de consommation					
Localiza Rent a Car S.A. (coût identifié, 0)	BRL 45,35	29/02/24	14	26	0,00
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 3 155 780 \$) (k)				2 749 839	98,51
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF				41 582	1,49
ACTIF NET				2 791 421	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS			
Aérospatiale et défense			
Thales S.A., 0 %, 26/03/2026	EUR 1 200 000	1 120 920	0,67
Thales S.A., 3,625 %, 14/06/2029	600 000	613 366	0,36

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Aérospatiale et défense, suite				
Thales S.A., 4,25 %, 18/10/2031	EUR	800 000	847 088	0,50
			2 581 374	1,53
Industrie de la confection				
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,25 %, 7/09/2029		800 000	813 773	0,48
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,5 %, 7/09/2033		600 000	620 306	0,37
			1 434 079	0,85
Créances adossées à des actifs et titrisées				
RAC Bond Co. PLC, 4,87 %, 6/05/2026	GBP	210 000	240 139	0,14
Industrie automobile				
Mercedes-Benz Finance Co. Ltd., 3,25 %, 10/01/2032	EUR	530 000	531 931	0,32
Schaeffler AG, 4,75 %, 14/08/2029		500 000	506 309	0,30
Volkswagen International Finance N.V., 7,5 %, 6/09/2172		500 000	542 460	0,32
Volkswagen International Finance N.V., 7,875 %, 6/09/2172		400 000	450 316	0,27
Volkswagen Leasing GmbH, 4 %, 11/04/2031		640 000	648 364	0,38
			2 679 380	1,59
Banques et services financiers diversifiés (Obligations couvertes)				
Royal Bank of Canada, 0,625 %, 10/09/2025		490 000	471 107	0,28
Radio-télévision				
Ubisoft Entertainment S.A., 0,878 %, 24/11/2027		1 500 000	1 239 375	0,73
WarnerMedia Holdings, Inc., 5,141 %, 15/03/2052	USD	500 000	397 690	0,24
			1 637 065	0,97
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Euroclear Bank S.A., 3,625 %, 13/10/2027	EUR	2 090 000	2 126 997	1,26
London Stock Exchange Group PLC, 1,75 %, 6/12/2027		600 000	573 033	0,34
LSEG Netherlands B.V., 4,231 %, 29/09/2030		830 000	874 149	0,51
LSEGA Financing PLC, 2 %, 6/04/2028	USD	1 480 000	1 229 827	0,73
			4 804 006	2,84
Construction				
CEMEX S.A.B. de C.V., 3,125 %, 19/03/2026	EUR	1 300 000	1 272 960	0,75
HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A., 4,875 %, 21/11/2033		685 000	737 567	0,44
Holcim Sterling Finance (Netherlands) B.V., 2,25 %, 4/04/2034	GBP	870 000	779 007	0,46
Imerys S.A., 4,75 %, 29/11/2029	EUR	600 000	618 149	0,37
			3 407 683	2,02
Services aux entreprises				
Corning, Inc., 4,125 %, 15/05/2031		1 190 000	1 238 718	0,73
Euronet Worldwide, Inc., 1,375 %, 22/05/2026		330 000	310 726	0,18
Visa, Inc., 2,375 %, 15/06/2034		1 210 000	1 144 290	0,68
			2 693 734	1,59
Télévision par câble				
SES S.A., 2,875 % jusqu'au 27/08/2026, FLR jusqu'au 27/08/2171		1 654 000	1 542 355	0,91
Produits chimiques				
Arkema S.A., 4,25 %, 20/05/2030		800 000	835 160	0,49
Arkema S.A., 1,5 % jusqu'au 21/01/2026, FLR jusqu'au 21/01/2171		1 200 000	1 125 026	0,67
			1 960 186	1,16
Conglomérats				
Siemens Financieringsmaatschappij N.V., 3,625 %, 24/02/2043		700 000	719 656	0,42
Veralto Corp., 4,15 %, 19/09/2031		1 520 000	1 564 721	0,93
			2 284 377	1,35
Biens de consommation				
Haleon Netherlands Capital B.V., 1,25 %, 29/03/2026		1 560 000	1 494 661	0,88
Services de consommation				
Compass Group PLC, 3,25 %, 6/02/2031		250 000	249 600	0,15
Rentokil Initial PLC, 5 %, 27/06/2032	GBP	850 000	989 030	0,59
Securitas Treasury Ireland DAC, 4,375 %, 6/03/2029	EUR	1 335 000	1 376 449	0,81
			2 615 079	1,55

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
CEZ A.S. (République tchèque), 2,375 %, 6/04/2027	EUR	1 955 000	1 876 104	1,11
Eustream A.S. (République slovaque), 1,625 %, 25/06/2027		1 030 000	867 775	0,51
Petroleos Mexicanos, 6,875 %, 4/08/2026	USD	1 604 000	1 447 640	0,86
			4 191 519	2,48
Obligations souveraines des marchés émergents				
République de Roumanie, 6,375 %, 18/09/2033	EUR	440 000	467 180	0,28
Énergie - Sociétés indépendantes				
Pioneer Natural Resources Co., 2,15 %, 15/01/2031	USD	1 570 000	1 237 538	0,73
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets B.V., 4,323 %, 12/05/2035	EUR	979 000	1 028 910	0,61
BP Capital Markets B.V., 0,933 %, 4/12/2040		1 435 000	927 641	0,55
Eni S.p.A., 3,875 %, 15/01/2034		1 220 000	1 235 606	0,73
Exxon Mobil Corp., 1,408 %, 26/06/2039		1 719 000	1 248 551	0,74
Galp Energia SGPS S.A., 2 %, 15/01/2026		500 000	483 040	0,28
			4 923 748	2,91
Ingénierie - Construction				
John Deere Bank S.A., 5,125 %, 18/10/2028	GBP	442 000	532 821	0,32
Établissements financiers				
CPI Property Group S.A., 3,75 % jusqu'au 27/07/2028, FLR jusqu'au 27/01/2170	EUR	550 000	214 500	0,13
CTP N.V., 4,75 %, 5/02/2030		190 000	191 552	0,11
Globalworth Ltd., REIT, 2,95 %, 29/07/2026		1 390 000	1 188 645	0,70
Grand City Properties S.A., 5,901 % jusqu'au 24/10/2023, FLR jusqu'au 24/10/2169		400 000	258 432	0,15
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 3 %, 14/01/2025		650 000	578 500	0,34
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,375 %, 4/09/2026		320 000	245 410	0,15
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 % jusqu'au 30/04/2025, FLR jusqu'au 30/04/2172		2 470 000	444 600	0,26
VGP N.V., 1,5 %, 8/04/2029		400 000	329 996	0,20
Vonovia SE, 5,5 %, 18/01/2036	GBP	500 000	577 679	0,34
			4 029 314	2,38
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V., 1,5 %, 18/04/2030	EUR	970 000	891 706	0,53
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V., 2 %, 23/01/2035		1 050 000	931 209	0,55
Carlsberg Breweries A.S., 0,875 %, 1/07/2029		1 942 000	1 720 410	1,02
Carlsberg Breweries A.S., 4,25 %, 5/10/2033		446 000	472 483	0,28
JDE Peet's N.V., 4,5 %, 23/01/2034		910 000	950 044	0,56
			4 965 852	2,94
Jeux et hôtellerie				
IHG Finance LLC, 4,375 %, 28/11/2029		1 110 000	1 153 553	0,68
Industrie				
Arcadis N.V., 4,875 %, 28/02/2028		1 281 000	1 335 263	0,79
Investor AB, 0,375 %, 29/10/2035		1 100 000	786 408	0,47
			2 121 671	1,26
Assurances				
Allianz SE, 4,851 % jusqu'au 26/07/2034, FLR jusqu'au 26/07/2054		800 000	820 022	0,48
Allianz SE, 3,2 % jusqu'au 30/04/2028, FLR jusqu'au 30/04/2171	USD	2 000 000	1 476 408	0,87
ASR Nederland N.V., 7 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2043	EUR	1 390 000	1 569 838	0,93
Assicurazioni Generali S.p.A., 3,547 %, 15/01/2034		1 290 000	1 285 563	0,76
Axa S.A., 6,375 % jusqu'au 16/01/2034, FLR jusqu'au 16/07/2172		490 000	499 188	0,30
Bupa Finance PLC, 4 % jusqu'au 24/03/2032, FLR jusqu'au 30/12/2099	GBP	1 580 000	1 280 756	0,76
Groupe des Assurances du Credit Mutuel, 1,85 % jusqu'au 21/04/2032, FLR jusqu'au 21/04/2042	EUR	1 400 000	1 132 569	0,67
Sogecap S.A., 6,5 % jusqu'au 16/05/2034, FLR jusqu'au 16/05/2044		1 100 000	1 194 965	0,71
			9 259 309	5,48
Assurances IARD				
Berkshire Hathaway, Inc., 0,5 %, 15/01/2041		1 680 000	1 041 563	0,62
QBE Insurance Group Ltd., 2,5 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2038	GBP	242 000	239 920	0,14
			1 281 483	0,76

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations quasi souveraines du marché international				
Aéroports de Paris, 2,75 %, 2/04/2030	EUR	1 500 000	1 468 794	0,87
Belfius Bank S.A. (Royaume de Belgique), 3,875 %, 12/06/2028		1 600 000	1 631 549	0,97
Belfius Bank S.A. (Royaume de Belgique), 3,75 %, 22/01/2029		800 000	801 330	0,47
Belfius Bank S.A. (Royaume de Belgique), 4,125 %, 12/09/2029		1 200 000	1 239 970	0,73
Deutsche Bahn Finance GmbH, 3,375 %, 29/01/2038		330 000	330 874	0,20
EnBW International Finance B.V. (République fédérale d'Allemagne), 3,5 %, 24/07/2028		640 000	650 722	0,39
EnBW International Finance B.V. (République fédérale d'Allemagne), 3,85 %, 23/05/2030		1 335 000	1 373 149	0,81
Logicor Financing S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 4,625 %, 25/07/2028		300 000	302 647	0,18
Logicor Financing S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 1,625 %, 17/01/2030		270 000	229 119	0,14
NBN Co. Ltd. (Commonwealth d'Australie), 4,375 %, 15/03/2033		2 242 000	2 369 251	1,40
P3 Group S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 1,625 %, 26/01/2029		240 000	209 376	0,12
			10 606 781	6,28
Autorités locales				
Province d'Ontario, 0,625 %, 17/04/2025		810 000	785 068	0,46
Grandes banques				
Banco BPM S.p.A, 4,625 %, 29/11/2027		590 000	608 097	0,36
Banco de Sabadell S.A., 9,375 % jusqu'au 18/01/2029, FLR jusqu'au 18/04/2172		200 000	213 420	0,13
BNP Paribas, 4,75 %, 13/11/2032		800 000	847 990	0,50
BNP Paribas S.A., 4,25 % jusqu'au 13/04/2030, FLR jusqu'au 13/04/2031		1 000 000	1 033 234	0,61
BNP Paribas S.A., FLR, 5,97 %, 23/03/2172	USD	910 000	838 257	0,50
Credit Agricole S.A., 6,316 % jusqu'au 3/10/2028, FLR jusqu'au 3/10/2029		1 250 000	1 206 167	0,71
Credit Agricole S.A., 3,875 %, 20/04/2031	EUR	1 800 000	1 858 028	1,10
Credit Agricole S.A., 6,375 %, 14/06/2031	GBP	300 000	375 313	0,22
Credit Agricole S.A., 3,75 %, 22/01/2034	EUR	800 000	808 824	0,48
Danske Bank A.S., 4,298 % jusqu'au 1/04/2027, FLR jusqu'au 1/04/2028	USD	510 000	458 656	0,27
Erste Group Bank AG, 4,25 % jusqu'au 30/05/2029, FLR jusqu'au 30/05/2030	EUR	1 100 000	1 141 206	0,68
HSBC Holdings PLC, 6,8 %, 14/09/2031	GBP	190 000	240 027	0,14
HSBC Holdings PLC, 4,787 % jusqu'au 10/03/2031, FLR jusqu'au 10/03/2032	EUR	600 000	634 465	0,38
HSBC Holdings PLC, 4,856 % jusqu'au 23/05/2032, FLR jusqu'au 23/05/2033		565 000	601 559	0,36
JPMorgan Chase & Co., 1,812 % jusqu'au 12/06/2028, FLR jusqu'au 12/06/2029		1 742 000	1 630 331	0,97
Lloyds Banking Group PLC, 4,75 % jusqu'au 21/09/2030, FLR jusqu'au 21/09/2031		280 000	293 669	0,17
mBank S.A., 8,375 % jusqu'au 11/09/2026, FLR jusqu'au 11/09/2027		700 000	738 430	0,44
Morgan Stanley, 1,102 %, 29/04/2033		2 110 000	1 720 089	1,02
NatWest Group PLC, 4,771 %, 16/02/2029		1 350 000	1 400 261	0,83
NatWest Markets PLC, 3,625 %, 9/01/2029		810 000	812 995	0,48
Société Générale S.A., 5,625 %, 2/06/2033		1 100 000	1 171 513	0,69
Svenska Handelsbanken AB, 3,375 %, 17/02/2028		2 210 000	2 227 857	1,32
Toronto-Dominion Bank, 5,288 %, 11/01/2028	GBP	330 000	392 695	0,23
UBS AG, 9,25 %, 13/05/2172	USD	245 000	242 504	0,14
UBS Group AG, 4,75 % jusqu'au 17/03/2031, FLR jusqu'au 17/03/2032	EUR	450 000	473 630	0,28
UBS Group AG, 4,125 % jusqu'au 9/06/2032, FLR jusqu'au 9/06/2033		810 000	818 805	0,48
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026	USD	410 000	359 405	0,21
UniCredit S.p.A., 4,3 %, 23/01/2031	EUR	1 140 000	1 146 259	0,68
UniCredit S.p.A., 5,375 %, 16/04/2034		740 000	746 771	0,44
			25 040 457	14,82
Technologies et services médicaux et de santé				
Thermo Fisher Scientific (Finance I) B.V., 2 %, 18/10/2051		1 905 000	1 345 962	0,79
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2,375 %, 15/04/2032		870 000	823 043	0,49
			2 169 005	1,28
Équipements médicaux				
Boston Scientific Corp., 0,625 %, 1/12/2027		1 330 000	1 213 346	0,72
Gaz naturel - Distribution				
ENGIE Energía Chile S.A., 3,875 %, 6/12/2033		800 000	821 800	0,49
ENGIE S.A., 4,5 %, 6/09/2042		200 000	212 055	0,12

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Gaz naturel - Distribution, suite				
ENGIE S.A., 4,25 %, 11/01/2043	EUR	200 000	205 672	0,12
			1 239 527	0,73
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 0,75 %, 15/03/2029		660 000	576 193	0,34
APA Infrastructure Ltd., 2,5 %, 15/03/2036	GBP	1 740 000	1 465 031	0,87
APA Infrastructure Ltd., 7,125 % jusqu'au 9/02/2029, FLR jusqu'au 9/11/2083	EUR	1 485 000	1 587 064	0,94
			3 628 288	2,15
Réseaux et télécommunications				
Orange S.A., 3,625 %, 16/11/2031		1 300 000	1 346 124	0,80
Orange S.A., 3,875 %, 11/09/2035		500 000	524 383	0,31
			1 870 507	1,11
Services pétroliers				
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 5,25 %, 23/01/2084		400 000	406 256	0,24
Pétrole				
Neste Oyj, 3,875 %, 21/05/2031		590 000	608 009	0,36
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
ABANCA Corp. Bancaria S.A., 5,875 % jusqu'au 2/04/2029, FLR jusqu'au 2/04/2030		1 100 000	1 176 912	0,70
ABANCA Corp. Bancaria S.A., 8,375 % jusqu'au 23/09/2028, FLR jusqu'au 23/09/2033		1 100 000	1 200 177	0,71
AIB Group PLC, 2,25 % jusqu'au 4/04/2027, FLR jusqu'au 4/04/2028		860 000	825 729	0,49
AIB Group PLC, 5,25 %, 23/10/2031		850 000	909 075	0,54
Alpha Bank, 4,25 %, 13/02/2030		210 000	204 750	0,12
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 4,125 %, 14/06/2033		1 400 000	1 460 490	0,86
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 4,375 %, 11/01/2034		1 200 000	1 188 000	0,70
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 3,75 %, 3/02/2034		800 000	803 309	0,48
BPCE S.A., 4,75 % jusqu'au 14/06/2033, FLR jusqu'au 14/06/2034		1 300 000	1 381 733	0,82
BPCE S.A., 4,25 % jusqu'au 11/01/2034, FLR jusqu'au 11/01/2035		800 000	815 845	0,48
CaixaBank S.A., 4,625 %, 16/05/2027		900 000	917 102	0,54
CaixaBank S.A., 5 % jusqu'au 19/07/2028, FLR jusqu'au 19/07/2029		600 000	627 613	0,37
CaixaBank S.A., 4,25 %, 6/09/2030		900 000	935 791	0,55
CaixaBank S.A., 8,25 % jusqu'au 13/09/2029, FLR jusqu'au 13/06/2172		600 000	634 500	0,38
Commerzbank AG, 4,625 %, 17/01/2031		600 000	613 358	0,36
Cooperatieve Rabobank U.A., 4,233 %, 25/04/2029		1 300 000	1 340 422	0,79
Deutsche Bank AG, 3,75 % jusqu'au 15/01/2029, FLR jusqu'au 15/01/2030		800 000	803 859	0,48
Deutsche Bank AG, 6,125 % jusqu'au 12/12/2029, FLR jusqu'au 12/12/2030	GBP	200 000	236 196	0,14
Deutsche Bank AG, 4 % jusqu'au 24/06/2027, FLR jusqu'au 24/06/2032	EUR	1 100 000	1 060 759	0,63
Deutsche Bank AG, 10 % jusqu'au 30/04/2028, FLR jusqu'au 14/11/2171		800 000	863 032	0,51
Intesa Sanpaolo S.p.A., 5,125 %, 29/08/2031		770 000	830 171	0,49
Intesa Sanpaolo S.p.A., 7,2 %, 28/11/2033	USD	1 300 000	1 288 732	0,76
KBC Group N.V., 4,375 % jusqu'au 19/04/2029, FLR jusqu'au 19/04/2030	EUR	1 600 000	1 656 368	0,98
KBC Group N.V., 4,75 %, 17/04/2035		1 200 000	1 207 968	0,72
Macquarie Group Ltd., 4,08 %, 31/05/2029	GBP	400 000	447 453	0,27
Macquarie Group Ltd., 4,747 %, 23/01/2030	EUR	1 095 000	1 148 907	0,68
Macquarie Group Ltd., 0,95 %, 21/05/2031		1 745 000	1 461 172	0,86
Virgin Money UK PLC, 7,625 %, 23/08/2029	GBP	260 000	325 486	0,19
Virgin Money UK PLC, 11 % jusqu'au 8/06/2029, FLR jusqu'au 8/06/2172		600 000	719 807	0,43
			27 084 716	16,03
Produits pharmaceutiques				
Roche Finance Europe B.V., 3,586 %, 4/12/2036	EUR	700 000	729 722	0,43
Roche Holdings, Inc., 2,076 %, 13/12/2031	USD	1 600 000	1 239 138	0,73
			1 968 860	1,16
Immobilier - Distribution				
WEA Finance LLC, 2,875 %, 15/01/2027		330 000	276 155	0,16
Restaurants				
McDonald's Corp., 3,875 %, 20/02/2031	EUR	400 000	414 338	0,24

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS **au 31 janvier 2024**
MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Distribution				
B&M EuropeanValue Retail S.A., 8,125 %, 15/11/2030	GBP	182 000	226 498	0,13
Produits chimiques spéciaux				
Covestro AG, 1,375 %, 12/06/2030	EUR	720 000	638 784	0,38
Télécommunications mobiles				
Cellnex Finance Co. S.A., 2 %, 15/02/2033		400 000	343 810	0,20
Vodafone Group PLC, 3,375 %, 8/08/2049	GBP	820 000	658 186	0,39
			1 001 996	0,59
Services téléphoniques				
Deutsche Telekom AG, 1,375 %, 5/07/2034	EUR	900 000	774 491	0,46
Tabac				
B.A.T. International Finance PLC, 2,25 %, 16/01/2030		883 000	793 482	0,47
Transports - Services				
Aeroporti di Roma S.p.A., 4,875 %, 10/07/2033		2 515 000	2 644 832	1,57
Autostrade per l'Italia S.p.A., 5,125 %, 14/06/2033		740 000	777 119	0,46
Autostrade per l'Italia S.p.A., 4,75 %, 24/01/2031		570 000	590 268	0,35
Transurban Finance Co. Pty Ltd., 1,75 %, 29/03/2028		1 087 000	1 026 682	0,61
Transurban Finance Co. Pty Ltd., 1,45 %, 16/05/2029		560 000	510 311	0,30
Transurban Finance Co. Pty Ltd., 4,225 %, 26/04/2033		600 000	628 764	0,37
			6 177 976	3,66
Services publics - Énergie électrique				
AusNet Services Holdings Pty Ltd., 0,625 %, 25/08/2030		1 380 000	1 157 216	0,69
Duke Energy Carolinas LLC, 2,85 %, 15/03/2032	USD	550 000	440 451	0,26
E.ON International Finance B.V., 5,875 %, 30/10/2037	GBP	1 100 000	1 339 744	0,79
EDP Servicios Financieros Espana S.A., 4,375 %, 4/04/2032	EUR	235 000	250 253	0,15
Enel Finance International N.V., 2,25 %, 12/07/2031	USD	1 409 000	1 063 254	0,63
Enel Finance International N.V., 3,875 %, 23/01/2035	EUR	720 000	728 927	0,43
Enel Finance International N.V., 4,5 %, 20/02/2043		180 000	186 123	0,11
EPH Financing International A.S., 6,651 %, 13/11/2028		752 000	768 405	0,45
National Grid Electricity Transmission PLC, 2 %, 17/04/2040	GBP	400 000	296 092	0,18
National Grid PLC, 0,75 %, 1/09/2033	EUR	510 000	387 891	0,23
National Grid PLC, 4,275 %, 16/01/2035		1 320 000	1 353 834	0,80
SSE PLC, 4 %, 5/09/2031		275 000	285 874	0,17
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032	USD	810 000	727 140	0,43
			8 985 204	5,32
Services publics - Gaz				
EP Infrastructure A.S., 1,698 %, 30/07/2026	EUR	1 045 000	953 416	0,56
EP Infrastructure A.S., 2,045 %, 9/10/2028		530 000	451 046	0,27
			1 404 462	0,83
Total des obligations (coût identifié, 156 899 090 €)			161 323 419	95,46
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT				
Fonds communs de placement				
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 3,82 % (v) (coût identifié, 2 529 123 €)		2 529 123	2 529 123	1,50
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 159 428 213 €)			163 852 542	96,96

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS D'ACHAT ACHETÉES				
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3,5 %	16 242 071	13 960 000	156 374	0,09
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3,5 %	6 003 516	5 160 000	57 800	0,03

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Euro Credit Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
OPTIONS D'ACHAT ACHETÉES, suite				
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3 %	40 768 064	35 040 000	86 997	0,05
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3,5 %	5 351 972	4 600 000	51 527	0,03
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3,5 %	4 770 236	4 100 000	45 927	0,03
Total des Options d'Achat Achetées (primes versées, 269 792 €)			398 625	0,23
Total des investissements (coût identifié, 159 698 005 €) (k)			164 251 167	97,19
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			4 740 811	2,81
ACTIF NET			168 991 978	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - European Core Equity Fund

(en euros)

Nom du titre

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé

ACTIONS ORDINAIRES

Aérospatiale et défense

	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
MTU Aero Engines Holding AG	5 102	1 090 298	0,83
Rolls-Royce Holdings PLC	438 760	1 543 008	1,18
		2 633 306	2,01

Compagnies aériennes

Aena SME S.A.	9 873	1 616 965	1,23
Ryanair Holdings PLC, ADR	7 684	949 923	0,73
		2 566 888	1,96

Boissons alcoolisées

Carlsberg A.S., "B"	13 173	1 567 765	1,20
Diageo PLC	103 251	3 436 299	2,62
Heineken Holding N.V.	47 290	3 664 713	2,80
Pernod Ricard S.A.	17 945	2 732 888	2,08
		11 401 665	8,70

Industrie de la confection

Burberry Group PLC	111 502	1 710 270	1,31
Compagnie Financière Richemont S.A.	28 092	3 885 810	2,97
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	6 576	5 060 852	3,86
Swatch Group Ltd.	2 507	543 655	0,41
		11 200 587	8,55

Industrie automobile

Aptiv PLC	12 606	948 687	0,72
Knorr-Bremse AG	19 700	1 127 778	0,86
		2 076 465	1,58

Radio-télévision

WPP Group PLC	147 502	1 323 520	1,01
---------------	---------	-----------	------

Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs

Deutsche Boerse AG	7 507	1 386 918	1,06
IG Group Holdings PLC	161 861	1 341 463	1,02
London Stock Exchange Group PLC	14 691	1 538 577	1,18
Rathbones Group PLC	29 806	573 139	0,44
		4 840 097	3,70

Services aux entreprises

Brenntag AG	19 571	1 609 910	1,23
-------------	--------	-----------	------

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Core Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Services aux entreprises, suite			
Compass Group PLC	48 510	1 238 978	0,95
Experian PLC	40 162	1 549 355	1,18
Hays PLC	744 367	858 927	0,66
Intertek Group PLC	32 567	1 709 709	1,30
		6 966 879	5,32
Logiciels			
Check Point Software Technologies Ltd.	7 181	1 056 053	0,81
Dassault Systemes SE	27 268	1 315 272	1,00
Sage Group PLC	92 892	1 280 798	0,98
		3 652 123	2,79
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	19 802	1 280 858	0,98
Biens de consommation			
Beiersdorf AG	4 987	677 928	0,52
Essity AB	66 187	1 440 093	1,10
Reckitt Benckiser Group PLC	32 760	2 189 018	1,67
		4 307 039	3,29
Services de consommation			
Booking Holdings, Inc.	261	847 089	0,65
Équipements électriques			
Legrand S.A.	27 072	2 435 893	1,86
Schneider Electric SE	27 947	5 096 703	3,89
		7 532 596	5,75
Divertissement			
CTS Eventim AG	12 095	760 171	0,58
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	31 766	1 961 233	1,50
Nestlé S.A.	28 832	3 041 902	2,32
		5 003 135	3,82
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	7 766	1 477 554	1,13
Whitbread PLC	37 346	1 568 150	1,19
		3 045 704	2,32
Assurances			
Beazley PLC	262 543	1 676 380	1,28
Hiscox Ltd.	75 471	919 539	0,70
Willis Towers Watson PLC	10 003	2 279 762	1,74
		4 875 681	3,72
Internet			
Moneysupermarket.com Group PLC	271 047	809 910	0,62
Scout24 AG	18 392	1 260 755	0,96
		2 070 665	1,58
Loisirs et jouets			
Prosus N.V.	29 815	820 807	0,63
Machines et outils			
GEA Group AG	40 824	1 518 653	1,16
Grandes banques			
BNP Paribas	25 925	1 613 045	1,23
Erste Group Bank AG	74 866	2 998 383	2,29
ING Groep N.V.	109 753	1 444 515	1,11
UBS Group AG	109 591	3 028 703	2,31
		9 084 646	6,94
Équipements médicaux			
ConvaTec Group PLC	409 217	1 148 655	0,88
EssilorLuxottica	7 273	1 323 146	1,01

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Core Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Équipements médicaux, suite			
QIAGEN N.V.	23 719	956 286	0,73
Smith & Nephew PLC	63 183	820 771	0,63
Sonova Holding AG	3 556	1 050 040	0,80
		5 298 898	4,05
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Allfunds Group PLC	247 352	1 636 529	1,25
Julius Baer Group Ltd.	23 651	1 195 173	0,91
Jyske Bank A.S.	13 180	934 369	0,72
Sydbank A.S.	22 106	907 057	0,69
		4 673 128	3,57
Produits pharmaceutiques			
Merck KGaA	28 232	4 302 557	3,28
Novo Nordisk A.S., "B"	32 911	3 478 091	2,66
Roche Holding AG	14 530	3 841 470	2,93
		11 622 118	8,87
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	10 366	1 414 959	1,08
Immobilier			
Grand City Properties S.A.	44 172	398 431	0,30
LEG Immobilien SE	14 029	1 084 055	0,83
TAG Immobilien AG	71 089	928 327	0,71
Vonovia SE, REIT	88 937	2 576 453	1,97
		4 987 266	3,81
Produits chimiques spéciaux			
Air Liquide S.A.	13 324	2 310 942	1,76
Akzo Nobel N.V.	28 264	2 001 673	1,53
Croda International PLC	28 321	1 595 792	1,22
Linde PLC	10 720	4 015 709	3,07
Symrise AG	19 838	1 903 258	1,45
		11 827 374	9,03
Magasins spécialisés			
Hermes International	656	1 281 342	0,98
Télécommunications mobiles			
Cellnex Telecom S.A.	40 057	1 427 240	1,09
Total des actions ordinaires (coût identifié, 116 686 648 €)		130 340 899	99,52
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 3,82 % (v) (coût identifié, 648 451 €)	648 451	648 451	0,49
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 117 335 099 €) (k)		130 989 350	100,01
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		(14 736)	(0,01)
ACTIF NET		130 974 614	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - European Research Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
MTU Aero Engines Holding AG	43 219	9 235 900	0,81
Rolls-Royce Holdings PLC	3 703 262	13 023 438	1,14

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Aérospatiale et défense, suite			
Thales S.A.	46 615	6 309 340	0,55
		28 568 678	2,50
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	112 346	13 888 612	1,22
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	659 445	21 947 002	1,92
Heineken N.V.	197 310	18 375 206	1,61
		40 322 208	3,53
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	377 858	5 795 763	0,51
Compagnie Financiere Richemont S.A.	149 785	20 718 923	1,81
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	56 048	43 134 221	3,78
		69 648 907	6,10
Industrie automobile			
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	399 640	12 316 905	1,08
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Deutsche Boerse AG	68 097	12 580 921	1,10
Euronext N.V.	131 572	10 719 660	0,94
IG Group Holdings PLC	1 540 584	12 767 966	1,12
London Stock Exchange Group PLC	182 032	19 064 071	1,67
		55 132 618	4,83
Services aux entreprises			
Eurofins Scientific SE	142 103	7 936 495	0,69
Experian PLC	585 380	22 582 573	1,98
		30 519 068	2,67
Logiciels			
Dassault Systemes SE	220 689	10 644 934	0,93
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	261 938	16 942 998	1,49
Cap Gemini S.A.	82 109	17 012 985	1,49
		33 955 983	2,98
Équipements électriques			
Legrand S.A.	121 397	10 923 096	0,96
Schneider Electric SE	205 464	37 470 536	3,28
		48 393 632	4,24
Électronique			
ASML Holding N.V.	60 013	47 593 215	4,17
Énergie - Sociétés intégrées			
Aker BP ASA	304 029	7 460 765	0,65
Eni S.p.A.	977 965	14 473 998	1,27
Galp Energia SGPS S.A., "B"	813 823	11 810 194	1,04
TotalEnergies SE	458 907	27 655 881	2,42
		61 400 838	5,38
Alimentation et boissons			
Nestlé S.A.	434 781	45 871 297	4,02
Novozymes A/S	173 166	8 210 098	0,72
		54 081 395	4,74
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Tesco PLC	3 331 009	11 182 830	0,98
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	95 326	18 136 665	1,59
Whitbread PLC	222 222	9 331 049	0,82
		27 467 714	2,41
Marchandises générales			
B&M European Value Retail S.A.	1 606 114	9 728 767	0,85

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Insurance Beazley PLC	2 443 258	15 600 607	1,37
Hiscox Ltd.	861 764	10 499 731	0,92
Sampo OYJ, "A"	260 815	10 115 710	0,88
		36 216 048	3,17
Internet			
Scout24 AG	127 471	8 738 023	0,77
Machines et outils			
GEA Group AG	218 106	8 113 543	0,71
Weir Group PLC	334 597	7 139 181	0,63
		15 252 724	1,34
Grandes banques			
ABN AMRO Group N.V., GDR	773 724	10 587 502	0,93
Bank of Ireland Group PLC	1 341 153	11 387 380	1,00
BNP Paribas	365 646	22 750 375	1,99
Danske Bank A.S.	506 682	12 619 157	1,11
NatWest Group PLC	5 759 910	15 114 277	1,32
UBS Group AG	547 467	15 130 025	1,33
		87 588 716	7,68
Équipements médicaux			
ConvaTec Group PLC	3 247 571	9 115 794	0,80
QIAGEN N.V.	327 566	13 206 349	1,16
		22 322 143	1,96
Métaux et exploitation minière			
Glencore PLC	2 671 588	13 172 194	1,15
Services pétroliers			
Tenaris S.A.	571 544	8 383 761	0,74
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Allfunds Group PLC	1 777 751	11 761 944	1,03
Produits pharmaceutiques			
Novo Nordisk A.S., "B"	285 639	30 186 820	2,65
Roche Holding AG	137 776	36 425 496	3,19
Sanofi	268 384	24 936 486	2,18
		91 548 802	8,02
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	231 273	31 568 765	2,77
Immobilier			
Big Yellow Group PLC, REIT	340 863	4 562 933	0,40
Safestore Holdings PLC, REIT	852 118	8 169 777	0,72
		12 732 710	1,12
Restaurants			
Sodexo	90 864	9 504 374	0,83
Produits chimiques spéciaux			
Akzo Nobel N.V.	125 252	8 870 423	0,78
Croda International PLC	174 869	9 853 272	0,86
Linde PLC	89 404	33 490 714	2,94
Symrise AG	128 366	12 315 434	1,08
		64 529 843	5,66
Magasins spécialisés			
NEXT PLC	129 469	12 806 614	1,12
Zalando SE	115 760	2 162 397	0,19
		14 969 011	1,31
Télécommunications mobiles			
Cellnex Telecom S.A.	433 432	15 443 280	1,36
Wireless Infrastructure Italian S.p.A.	1 545 721	17 381 632	1,52
		32 824 912	2,88

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Research Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Services téléphoniques			
Koninklijke KPN N.V.	2 061 270	6 488 878	0,57
Tele2 AB, "B"	1 157 159	9 134 252	0,80
		15 623 130	1,37
Tabac			
British American Tobacco PLC	678 161	18 530 248	1,62
Services publics - Énergie électrique			
E.ON SE	1 282 178	16 104 155	1,41
Iberdrola S.A.	1 779 644	19 840 504	1,74
National Grid PLC	1 418 798	17 475 516	1,53
		53 420 175	4,68
Services publics - Eau			
Severn Trent PLC	298 383	9 071 395	0,80
Total des actions ordinaires (coût identifié, 952 718 906 €)		1 112 605 222	97,51
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 3,82 % (v) (coût identifié, 12 337 418 €)	12 337 418	12 337 418	1,08
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 965 056 324 €) (k)		1 124 942 640	98,59
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		16 090 894	1,41
ACTIF NET		1 141 033 534	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - European Smaller Companies Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
LISI Group	58 658	1 278 744	0,69
Compagnies aériennes			
Enav S.p.A.	764 889	2 623 569	1,42
Boissons alcoolisées			
Carlsberg A.S., "B"	33 767	4 018 729	2,18
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	45 109	691 903	0,38
Biotechnologies			
Probi AB	17 069	312 650	0,17
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Euronext N.V.	31 291	2 549 394	1,38
Rathbones Group PLC	37 541	721 876	0,39
		3 271 270	1,77
Services aux entreprises			
Amadeus Fire AG	5 747	643 664	0,35
Bunzl PLC	78 230	2 943 481	1,59
Compass Group PLC	159 732	4 079 661	2,21
Gruppo Mutuonline S.p.A.	88 171	2 812 655	1,52
Intertek Group PLC	57 972	3 043 426	1,65
Johnson Service Group PLC	1 335 345	2 289 365	1,24
Karnov Group AB	258 088	1 291 993	0,70
RS Group PLC	384 291	3 522 760	1,91
		20 627 005	11,17

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Smaller Companies Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Produits chimiques			
Borregaard ASA	181 623	2 866 724	1,55
IMCD Group N.V.	17 296	2 436 069	1,32
		5 302 793	2,87
Logiciels			
Lectra	30 664	1 000 255	0,54
Logiciels - Systèmes			
Alten S.A.	5 103	730 400	0,40
Amadeus IT Group S.A.	42 223	2 731 121	1,48
Kardex AG	9 809	2 311 307	1,25
		5 772 828	3,13
Construction			
Bellway PLC	31 162	1 000 073	0,54
Breedon Group PLC	1 383 273	5 832 479	3,16
Forterra PLC	1 958 847	3 763 527	2,04
		10 596 079	5,74
Biens de consommation			
Essity AB	115 277	2 508 190	1,36
Henkel AG & Co. KGaA	15 856	1 006 303	0,55
Sarantis S.A.	381 071	3 345 803	1,81
		6 860 296	3,72
Conteneurs			
Elopak ASA	1 055 560	2 795 745	1,51
Huhtamaki Oyj	57 235	2 081 637	1,13
Mayr-Melnhof Karton AG	23 142	2 832 581	1,53
Vetropack Holding AG	46 353	1 868 852	1,01
Vidrala S.A.	26 519	2 463 615	1,34
Viscofan S.A.	37 432	2 028 814	1,10
		14 071 244	7,62
Équipements électriques			
Cembre S.p.A.	179 160	7 184 316	3,89
Legrand S.A.	30 688	2 761 254	1,50
		9 945 570	5,39
Électronique			
ASM International N.V.	2 150	1 109 830	0,60
Énergie - Sociétés intégrées			
Galp Energia SGPS S.A., "B"	266 677	3 870 015	2,10
Divertissement			
CTS Eventim AG	49 206	3 092 597	1,68
Alimentation et boissons			
Bakkafrost P/F	42 315	2 186 020	1,18
Cloetta AB, "B"	829 347	1 381 204	0,75
Cranswick PLC	158 026	7 437 361	4,03
		11 004 585	5,96
Meubles et appareils			
Howden Joinery Group PLC	116 245	1 094 349	0,59
SEB S.A.	10 796	1 222 215	0,66
		2 316 564	1,25
Marchandises générales			
B&M European Value Retail S.A.	274 599	1 663 338	0,90
Assurances			
Linea Directa Aseguradora S.A.	764 700	739 465	0,40
Unipol Gruppo S.p.A.	312 114	1 797 777	0,97
		2 537 242	1,37
Internet			
Rightmove PLC	168 262	1 098 643	0,60

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Smaller Companies Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Internet, suite			
Scout24 AG	16 756	1 148 609	0,62
		2 247 252	1,22
Machines et outils			
GEA Group AG	98 424	3 661 373	1,98
Rotork PLC	250 111	915 815	0,50
Spirax-Sarco Engineering PLC	7 084	825 036	0,45
		5 402 224	2,93
Technologies et services médicaux et de santé			
Selcuk Ecza Deposu Ticaret ve Sanayi A.S.	986 179	1 834 396	0,99
Équipements médicaux			
ConvaTec Group PLC	818 266	2 296 838	1,24
Gerresheimer AG	56 737	5 384 341	2,92
Össur hf. (I)	351 058	1 412 863	0,76
Paul Hartmann AG	833	195 755	0,11
Smith & Nephew PLC	249 635	3 242 854	1,76
Sonova Holding AG	8 276	2 443 795	1,32
		14 976 446	8,11
Gaz naturel - Distribution			
DCC PLC	32 385	2 175 982	1,18
Italgas S.p.A.	709 882	3 743 838	2,03
		5 919 820	3,21
Services pétroliers			
Tecnicas Reunidas SA	161 674	1 259 440	0,68
Produits pharmaceutiques			
BioGaia AB, "B"	49 772	498 319	0,27
Chemins de fer et transport maritime			
Irish Continental Group PLC	518 848	2 389 295	1,29
Immobilier			
Irish Residential Properties PLC, REIT	645 433	742 755	0,40
LEG Immobilien SE	44 335	3 425 875	1,86
Unite Group PLC, REIT	174 056	2 054 108	1,11
		6 222 738	3,37
Restaurants			
Greggs PLC	96 140	3 001 769	1,62
Sodexo	65 791	6 881 739	3,73
		9 883 508	5,35
Produits chimiques spéciaux			
Corticeira Amorim, SGPS S.A.	201 398	1 903 211	1,03
Croda International PLC	73 836	4 160 407	2,25
Essentra PLC	1 459 460	2 960 824	1,61
Symrise AG (g)	73 751	7 075 671	3,83
		16 100 113	8,72
Magasins spécialisés			
Just Eat Takeaway.com	105 165	1 484 253	0,80
Télécommunications mobiles			
Cellnex Telecom S.A.	83 376	2 970 706	1,61
Total des actions ordinaires (coût identifié, 157 834 608 €)		183 155 616	99,20

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Smaller Companies Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 3,82 % (v) (coût identifié, 179 067 €)	179 067	179 067	0,10
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 158 013 675 €) (k)		183 334 683	99,30
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		1 300 437	0,70
ACTIF NET		184 635 120	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - European Value Fund

(en euros)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Safran S.A.	558 995	96 860 646	3,17
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	303 014	37 459 667	1,23
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	2 078 753	69 183 021	2,26
Heineken N.V.	816 492	76 038 763	2,49
Pernod Ricard S.A.	279 923	42 630 159	1,40
		187 851 943	6,15
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	2 153 510	33 031 547	1,08
Compagnie Financiere Richemont S.A.	719 835	99 570 755	3,26
		132 602 302	4,34
Industrie automobile			
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	1 165 460	35 919 477	1,18
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Deutsche Boerse AG	363 199	67 101 015	2,20
London Stock Exchange Group PLC	474 951	49 741 253	1,63
		116 842 268	3,83
Services aux entreprises			
Experian PLC	1 904 221	73 460 332	2,41
Intertek Group PLC	1 104 997	58 010 354	1,90
Rentokil Initial PLC	9 960 075	47 583 820	1,56
		179 054 506	5,87
Logiciels			
Dassault Systemes SE	1 121 449	54 093 093	1,77
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	1 174 262	75 955 069	2,49
Cap Gemini S.A.	210 909	43 700 345	1,43
Temenos AG	317 704	30 046 157	0,99
		149 701 571	4,91
Biens de consommation			
Beiersdorf AG	233 572	31 751 572	1,04
Haleon PLC	9 613 371	36 243 569	1,19
Reckitt Benckiser Group PLC	752 079	50 253 794	1,64
		118 248 935	3,87
Équipements électriques			
Legrand S.A.	557 016	50 119 355	1,64
Schneider Electric SE	508 420	92 720 719	3,04
		142 840 074	4,68

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Électronique			
ASML Holding N.V.	72 134	57 205 755	1,87
Infineon Technologies AG	1 288 587	43 483 368	1,43
		100 689 123	3,30
Énergie - Sociétés intégrées			
Aker BP ASA	1 069 381	26 242 235	0,86
Alimentation et boissons			
Nestlé S.A.	1 118 174	117 972 247	3,86
Novozymes A/S (I)	905 970	42 953 595	1,41
		160 925 842	5,27
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	261 870	49 823 223	1,63
Insurance Aon PLC	164 682	45 476 117	1,49
Beazley PLC	5 849 748	37 351 610	1,22
Willis Towers Watson PLC	161 907	36 899 867	1,21
Zurich Insurance Group AG	83 375	39 256 214	1,29
		158 983 808	5,21
Machines et outils			
Aalberts Industries N.V.	805 869	29 438 000	0,96
CNH Industrial Capital LLC	4 060 528	45 087 746	1,48
GEA Group AG	902 856	33 586 243	1,10
Schindler Holding AG	171 923	39 819 597	1,30
Weir Group PLC	2 525 501	53 885 744	1,77
		201 817 330	6,61
Grandes banques			
Erste Group Bank AG	1 203 981	48 219 439	1,58
ING Groep N.V.	2 847 909	37 482 783	1,23
UBS Group AG	2 503 511	69 188 069	2,27
		154 890 291	5,08
Équipements médicaux			
QIAGEN N.V.	398 685	16 073 603	0,53
Métaux et exploitation minière			
Anglo American PLC	1 174 550	25 796 868	0,85
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
AIB Group PLC	8 899 481	36 104 883	1,18
Allfunds Group PLC	2 830 032	18 724 038	0,61
Julius Baer Group Ltd.	530 731	26 819 815	0,88
Jyske Bank A.S.	398 627	28 259 855	0,93
		109 908 591	3,60
Produits pharmaceutiques			
Merck KGaA	248 182	37 822 937	1,24
Novo Nordisk A.S., "B"	489 363	51 716 722	1,69
Roche Holding AG	173 364	45 834 323	1,50
Sanofi	906 331	84 210 348	2,76
		219 584 330	7,19
Immobilier			
LEG Immobilien SE	270 863	20 930 253	0,69
Vonovia SE, REIT	764 468	22 146 191	0,72
		43 076 444	1,41
Restaurants			
Sodexo	571 356	59 763 838	1,96
Produits chimiques spéciaux			
Croda International PLC	724 955	40 848 745	1,34
Symrise AG	751 196	72 069 744	2,36
		112 918 489	3,70

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - European Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (€)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Magasins spécialisés			
Zalando SE	817 929	15 278 914	0,50
Télécommunications mobiles			
Cellnex Telecom S.A.	1 901 074	67 735 694	2,22
Services téléphoniques			
Tele2 AB, "B"	4 482 229	35 381 317	1,16
Services publics - Énergie électrique			
E.ON SE	2 583 831	32 452 917	1,06
Iberdrola S.A.	8 347 763	93 065 720	3,05
National Grid PLC	2 565 800	31 603 286	1,03
RWE AG	1 250 780	42 939 278	1,41
		200 061 201	6,55
Total des actions ordinaires (coût identifié, 2 638 986 902 €)		3 010 425 623	98,63
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT			
Fonds communs de placement			
State Street EUR Liquidity LVNAV Fund « Actions du Distributeur », 3,82 % (v) (coût identifié, 42 850 776 €)	42 850 776	42 850 776	1,40
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 681 837 678 €) (k)		3 053 276 399	100,03
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		(1 031 830)	(0,03)
ACTIF NET		3 052 244 569	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Global Concentrated Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Honeywell International, Inc.	103 307	20 894 874	3,65
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	628 119	22 591 434	3,95
Heineken N.V.	202 301	20 360 403	3,56
		42 951 837	7,51
Industrie de la confection			
Compagnie Financiere Richemont S.A.	182 681	27 308 476	4,77
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	30 211	25 126 510	4,39
		52 434 986	9,16
Radio-télévision			
Walt Disney Co.	150 555	14 460 808	2,53
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Charles Schwab Corp.	287 370	18 081 320	3,16
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	76 013	27 659 610	4,83
Télévision par câble			
Charter Communications, Inc., "A"	33 492	12 415 819	2,17
Comcast Corp., "A"	413 820	19 259 183	3,36
		31 675 002	5,53
Logiciels			
Oracle Corp.	183 919	20 543 752	3,59
Biens de consommation			
Reckitt Benckiser Group PLC	209 956	15 161 386	2,65

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Concentrated Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Équipements électriques			
Legrand S.A.	206 034	20 034 658	3,50
Schneider Electric SE	144 077	28 395 796	4,96
		48 430 454	8,46
Alimentation et boissons			
Nestlé S.A.	151 192	17 238 700	3,01
Assurances			
Willis Towers Watson PLC	102 549	25 257 819	4,41
Grandes banques			
Goldman Sachs Group, Inc.	60 172	23 106 650	4,04
Équipements médicaux			
Boston Scientific Corp.	347 894	22 007 774	3,84
Medtronic PLC	313 670	27 458 672	4,80
Thermo Fisher Scientific, Inc.	51 256	27 625 959	4,83
Waters Corp.	63 923	20 308 976	3,55
		97 401 381	17,02
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Visa, Inc., "A"	127 038	34 714 404	6,07
Produits pharmaceutiques			
Roche Holding AG	76 752	21 929 405	3,83
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian National Railway Co.	188 739	23 411 186	4,09
Produits chimiques spéciaux			
Akzo Nobel N.V.	130 055	9 953 870	1,74
Linde PLC	51 977	21 041 849	3,68
		30 995 719	5,42
Total des actions ordinaires (coût identifié, 442 324 419 \$)		566 349 293	98,96
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 442 324 419 \$) (k)		566 349 293	98,96
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		5 929 141	1,04
ACTIF NET		572 278 434	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS			
Aérospatiale et défense			
HEICO Corp., 5,35 %, 1/08/2033	USD 561 000	570 129	0,59
Thales S.A., 3,625 %, 14/06/2029	EUR 300 000	331 432	0,34
Thales S.A., 4,25 %, 18/10/2031	300 000	343 293	0,36
TransDigm, Inc., 6,875 %, 15/12/2030	USD 260 000	266 087	0,28
		1 510 941	1,57
Industrie de la confection			
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032	208 000	166 357	0,17
Créances adossées à des actifs et titrisées			
Onslow Bay Financial LLC OBX Trust, 2024-NQM1, "A", 5,928 %, 25/11/2063	99 632	100 165	0,10
RAC Bond Co. PLC, 4,87 %, 6/05/2026	GBP 200 000	247 160	0,26
		347 325	0,36
Industrie automobile			
Hyundai Capital America, 6,375 %, 8/04/2030	USD 298 000	317 267	0,33
LKQ Corp., 6,25 %, 15/06/2033	180 000	187 813	0,20

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Industrie automobile, suite				
Schaeffler AG, 4,75 %, 14/08/2029	EUR	200 000	218 867	0,23
Volkswagen International Finance N.V., 7,5 %, 6/09/2172		200 000	234 495	0,24
Volkswagen International Finance N.V., 7,875 %, 6/09/2172		200 000	243 328	0,25
Volkswagen Leasing GmbH, 4 %, 11/04/2031		160 000	175 172	0,18
			1 376 942	1,43
Radio-télévision				
Discovery Communications LLC, 4,125 %, 15/05/2029	USD	423 000	401 445	0,42
Prosus N.V., 3,68 %, 21/01/2030		220 000	191 626	0,20
Ubisoft Entertainment S.A., 0,878 %, 24/11/2027	EUR	900 000	803 636	0,83
WarnerMedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032	USD	499 000	456 889	0,47
			1 853 596	1,92
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Charles Schwab Corp., 5,643 % jusqu'au 19/05/2028, FLR jusqu'au 19/05/2029		180 000	184 168	0,19
Charles Schwab Corp., 6,136 % jusqu'au 24/08/2033, FLR jusqu'au 24/08/2034		227 000	239 907	0,25
Low Income Investment Fund, 3,386 %, 1/07/2026		45 000	42 402	0,04
Low Income Investment Fund, 3,711 %, 1/07/2029		115 000	100 835	0,10
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		634 000	584 306	0,61
			1 151 618	1,19
Construction				
CEMEX S.A.B. de C.V., 3,125 %, 19/03/2026	EUR	410 000	433 871	0,45
HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A., 4,875 %, 21/11/2033		230 000	267 636	0,28
Holcim Sterling Finance (Netherlands) B.V., 2,25 %, 4/04/2034	GBP	260 000	251 594	0,26
Imerys S.A., 4,75 %, 29/11/2029	EUR	300 000	334 017	0,34
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030	USD	406 000	376 811	0,39
			1 663 929	1,72
Services aux entreprises				
Corning, Inc., 4,125 %, 15/05/2031	EUR	300 000	337 483	0,35
Euronet Worldwide, Inc., 1,375 %, 22/05/2026		320 000	325 626	0,33
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049	USD	331 000	288 257	0,30
Mastercard, Inc., 3,85 %, 26/03/2050		223 000	190 677	0,20
			1 142 043	1,18
Télévision par câble				
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 6,384 %, 23/10/2035		91 000	91 751	0,10
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 4,8 %, 1/03/2050		243 000	185 508	0,19
Cox Communications, Inc., 5,45 %, 15/09/2028		362 000	369 415	0,38
SES S.A., 2,875 % jusqu'au 27/08/2026, FLR jusqu'au 27/08/2171	EUR	680 000	685 272	0,71
			1 331 946	1,38
Produits chimiques				
Arkema S.A., 4,25 %, 20/05/2030		200 000	225 639	0,23
Arkema S.A., 1,5 % jusqu'au 21/01/2026, FLR jusqu'au 21/01/2171		300 000	303 954	0,32
			529 593	0,55
Logiciels				
Microsoft Corp., 2,525 %, 1/06/2050	USD	227 000	151 487	0,16
Microsoft Corp., 2,921 %, 17/03/2052		265 000	190 214	0,20
Oracle Corp., 4 %, 15/07/2046		264 000	213 000	0,22
			554 701	0,58
Logiciels - Systèmes				
Apple, Inc., 4,5 %, 23/02/2036		261 000	265 285	0,28
Conglomérats				
Grupo KUO S.A.B. de C.V., 5,75 %, 7/07/2027		269 000	242 434	0,25
nVent Finance S.à r.l., 5,65 %, 15/05/2033		426 000	437 238	0,45
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		546 000	553 998	0,57
Veralto Corp., 4,15 %, 19/09/2031	EUR	233 000	259 212	0,27

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Conglomérats, suite				
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,7 %, 15/09/2028	USD	326 000	322 888	0,34
			1 815 770	1,88
Biens de consommation				
Kenvue, Inc., 5,05 %, 22/03/2053		501 000	505 211	0,52
Services de consommation				
Compass Group PLC, 3,25 %, 6/02/2031	EUR	130 000	140 266	0,15
Rentokil Initial PLC, 5 %, 27/06/2032	GBP	440 000	553 284	0,57
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPF, 0 %, 15/02/2027	USD	194 000	156 466	0,16
			850 016	0,88
Électronique				
Intel Corp., 5,7 %, 10/02/2053		299 000	314 535	0,33
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 3,4 %, 1/05/2030		154 000	140 758	0,14
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 5 %, 15/01/2033		69 000	68 022	0,07
SK hynix, Inc., 5,5 %, 16/01/2029		314 000	317 418	0,33
			840 733	0,87
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Bank Gospodarstwa Krajowego (République de Pologne), 5,375 %, 22/05/2033		200 000	200 666	0,21
Corporación Nacional del Cobre de Chile, 5,95 %, 8/01/2034		284 000	284 125	0,29
Emirates NBD Bank PJSC (Émirats arabes unis), 5,875 %, 11/10/2028		361 000	373 221	0,39
Eustream A.S. (République slovaque), 1,625 %, 25/06/2027	EUR	410 000	373 301	0,39
First Abu Dhabi Bank PJSC, 6,32 % jusqu'au 4/04/2031, FLR jusqu'au 4/04/2034	USD	342 000	351 190	0,36
Magyar Export-Import Bank PLC (République de Hongrie), 6,125 %, 4/12/2027		408 000	411 160	0,43
Petroleos Mexicanos, 6,875 %, 4/08/2026		332 000	323 817	0,33
Qatar Petroleum, 3,125 %, 12/07/2041		213 000	157 603	0,16
			2 475 083	2,56
Obligations souveraines des marchés émergents				
Royaume d'Arabie Saoudite, 5,75 %, 16/01/2054		328 000	322 329	0,33
République de Roumanie, 6,375 %, 18/09/2033	EUR	240 000	275 390	0,29
États-Unis du Mexique, 2,659 %, 24/05/2031	USD	381 000	319 471	0,33
États-Unis du Mexique, 6,338 %, 4/05/2053		200 000	199 361	0,21
			1 116 551	1,16
Énergie - Sociétés indépendantes				
Occidental Petroleum Corp., 6,45 %, 15/09/2036		441 000	470 437	0,49
Pioneer Natural Resources Co., 2,15 %, 15/01/2031		453 000	385 889	0,40
Santos Finance Ltd., 6,875 %, 19/09/2033		351 000	373 690	0,38
			1 230 016	1,27
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets America, Inc., 4,812 %, 13/02/2033		272 000	271 729	0,28
BP Capital Markets B.V., 4,323 %, 12/05/2035	EUR	360 000	408 886	0,43
BP Capital Markets B.V., 0,933 %, 4/12/2040		160 000	111 777	0,12
Eni S.p.A., 3,875 %, 15/01/2034		230 000	251 741	0,26
Exxon Mobil Corp., 1,408 %, 26/06/2039		360 000	282 578	0,29
			1 326 711	1,38
Établissements financiers				
Avolon Holdings Funding Ltd., 5,25 %, 15/05/2024	USD	107 000	106 921	0,11
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,25 %, 15/04/2026		63 000	60 930	0,06
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,375 %, 1/05/2026		267 000	258 974	0,27
Corporacion Inmobiliaria Vesta S.A.B. de C.V., 3,625 %, 13/05/2031		553 000	467 288	0,48
CPI Property Group S.A., 3,75 % jusqu'au 27/07/2028, FLR jusqu'au 27/01/2170	EUR	380 000	160 160	0,17
CTP N.V., 0,875 %, 20/01/2026		300 000	303 983	0,32
CTP N.V., 4,75 %, 5/02/2030		110 000	119 848	0,12
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)	USD	292 000	281 415	0,29
Globalworth Ltd., REIT, 2,95 %, 29/07/2026	EUR	620 000	572 973	0,59
Grand City Properties S.A., 5,901 % jusqu'au 24/10/2023, FLR jusqu'au 24/10/2169		400 000	279 287	0,29
Jefferson Capital Holdings LLC, 9,5 %, 15/02/2029	USD	351 000	353 518	0,37

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Établissements financiers, suite				
Macquarie AirFinance Holdings Ltd., 8,125 %, 30/03/2029	USD	268 000	278 069	0,29
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 3 %, 14/01/2025	EUR	500 000	480 912	0,50
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 % jusqu'au 30/04/2025, FLR jusqu'au 30/04/2172		1 300 000	252 884	0,26
VGP N.V., 1,5 %, 8/04/2029		200 000	178 313	0,18
Vonovia SE, 5,5 %, 18/01/2036	GBP	200 000	249 719	0,26
			4 405 194	4,56
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V., 2 %, 23/01/2035	EUR	270 000	258 778	0,27
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4 %, 13/04/2028	USD	184 000	181 043	0,19
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4,375 %, 15/04/2038		349 000	331 923	0,34
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 5,55 %, 23/01/2049		153 000	161 918	0,17
Bacardi Ltd., 5,15 %, 15/05/2038		334 000	323 439	0,33
Bacardi-Martini B.V., 5,4 %, 15/06/2033		341 000	342 718	0,35
Carlsberg Breweries A.S., 4,25 %, 5/10/2033	EUR	157 000	179 745	0,19
Constellation Brands, Inc., 3,15 %, 1/08/2029	USD	153 000	141 271	0,15
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		555 000	463 063	0,48
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3 %, 2/02/2029		355 000	313 960	0,33
JDE Peet's N.V., 4,5 %, 23/01/2034	EUR	110 000	124 108	0,13
JM Smucker Co., 6,5 %, 15/11/2053	USD	205 000	231 624	0,24
Kraft Heinz Foods Co., 3,875 %, 15/05/2027		325 000	317 740	0,33
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 3,398 %, 9/06/2031		294 000	252 592	0,26
Viterra Finance B.V., 3,2 %, 21/04/2031		214 000	187 055	0,19
			3 810 977	3,95
Jeux et hôtellerie				
IHG Finance LLC, 4,375 %, 28/11/2029	EUR	100 000	112 310	0,11
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031	USD	431 000	374 235	0,39
			486 545	0,50
Industrie				
Arcadis N.V., 4,875 %, 28/02/2028	EUR	293 000	330 058	0,34
Trustees of the University of Pennsylvania, 2,396 %, 1/10/2050	USD	176 000	110 246	0,12
			440 304	0,46
Assurances				
Allianz SE, 4,851 % jusqu'au 26/07/2034, FLR jusqu'au 26/07/2054	EUR	300 000	332 324	0,34
Allianz SE, 3,2 % jusqu'au 30/04/2028, FLR jusqu'au 30/04/2171	USD	600 000	478 666	0,50
ASR Nederland N.V., 7 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2043	EUR	280 000	341 746	0,35
Assicurazioni Generali S.p.A., 3,547 %, 15/01/2034		680 000	732 348	0,76
Axa S.A., 6,375 % jusqu'au 16/01/2034, FLR jusqu'au 16/07/2172		160 000	176 154	0,18
Bupa Finance PLC, 4 % jusqu'au 24/03/2032, FLR jusqu'au 30/12/2099	GBP	840 000	735 858	0,76
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042	USD	515 000	440 796	0,46
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		298 000	305 943	0,32
Groupe des Assurances du Credit Mutuel, 1,85 % jusqu'au 21/04/2032, FLR jusqu'au 21/04/2042	EUR	300 000	262 279	0,27
Sogecap S.A., 6,5 % jusqu'au 16/05/2034, FLR jusqu'au 16/05/2044		100 000	117 400	0,12
			3 923 514	4,06
Assurances - Santé				
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035	USD	275 000	275 029	0,29
Assurances IARD				
American International Group, Inc., 5,125 %, 27/03/2033		420 000	425 071	0,44
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 3,9 %, 28/02/2052		290 000	228 590	0,24
Arthur J. Gallagher & Co., 6,5 %, 15/02/2034		186 000	204 038	0,21
Arthur J. Gallagher & Co., 6,75 %, 15/02/2054		251 000	290 134	0,30
Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,25 %, 6/12/2027	CAD	630 000	459 470	0,48
QBE Insurance Group Ltd., 2,5 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2038	GBP	230 000	246 425	0,25
RenaissanceRe Holdings Ltd., 5,75 %, 5/06/2033	USD	353 000	358 088	0,37
			2 211 816	2,29

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations quasi souveraines du marché international				
Belfius Bank S.A. (Royaume de Belgique), 3,75 %, 22/01/2029	EUR	200 000	216 499	0,22
Deutsche Bahn Finance GmbH, 3,375 %, 29/01/2038		80 000	86 685	0,09
Enbw International Finance B.V. (République fédérale d'Allemagne), 4,3 %, 23/05/2034		170 000	193 603	0,20
Logicor Financing S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 4,625 %, 25/07/2028		130 000	141 731	0,15
Logicor Financing S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 1,625 %, 17/01/2030		350 000	320 975	0,33
NBN Co. Ltd. (Commonwealth d'Australie), 5,75 %, 6/10/2028	USD	388 000	403 649	0,42
NBN Co. Ltd. (Commonwealth d'Australie), 4,375 %, 15/03/2033	EUR	301 000	343 754	0,36
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties, 2,5 %, 15/10/2031	USD	287 000	231 059	0,24
P3 Group S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 1,625 %, 26/01/2029	EUR	270 000	254 557	0,26
			2 192 512	2,27
Obligations souveraines du marché international				
Gouvernement des Bermudes, 2,375 %, 20/08/2030	USD	200 000	168 260	0,18
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		200 000	194 000	0,20
			362 260	0,38
Autorités locales				
Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18/06/2050	CAD	275 000	163 638	0,17
Machines et outils				
Ashtead Capital, Inc., 5,95 %, 15/10/2033	USD	444 000	452 203	0,47
CNH Industrial Capital LLC, 1,875 %, 15/01/2026		194 000	182 677	0,19
CNH Industrial Capital LLC, 5,5 %, 12/01/2029		373 000	383 589	0,40
			1 018 469	1,06
Grandes banques				
Banco BPM S.p.A., 4,625 %, 29/11/2027	EUR	230 000	256 185	0,27
Banco de Sabadell S.A., 9,375 % jusqu'au 18/01/2029, FLR jusqu'au 18/04/2172		200 000	230 643	0,24
Bank of America Corp., 5,202 % jusqu'au 25/04/2028, FLR jusqu'au 25/04/2029	USD	447 000	450 656	0,47
Bank of America Corp., 2,687 % jusqu'au 22/04/2031, FLR jusqu'au 22/04/2032		457 000	387 957	0,40
BNP Paribas S.A., FLR, 5,97 %, 23/03/2172		770 000	766 535	0,79
Capital One Financial Corp., 6,377 % jusqu'au 8/06/2033, FLR jusqu'au 8/06/2034		259 000	269 109	0,28
Commonwealth Bank of Australia, 2,688 %, 11/03/2031		479 000	398 331	0,41
Credit Agricole S.A., 6,316 % jusqu'au 3/10/2028, FLR jusqu'au 3/10/2029		448 000	467 176	0,48
Credit Agricole S.A., 3,75 %, 22/01/2034	EUR	100 000	109 262	0,11
HSBC Holdings PLC, 2,099 % jusqu'au 4/06/2025, FLR jusqu'au 4/06/2026	USD	465 000	444 643	0,46
HSBC Holdings PLC, 4,787 % jusqu'au 10/03/2031, FLR jusqu'au 10/03/2032	EUR	280 000	319 978	0,33
HSBC Holdings PLC, 4,856 % jusqu'au 23/05/2032, FLR jusqu'au 23/05/2033		285 000	327 929	0,34
JPMorgan Chase & Co., 5,04 % jusqu'au 23/01/2027, FLR jusqu'au 23/01/2028	USD	282 000	283 206	0,29
JPMorgan Chase & Co., 1,953 % jusqu'au 4/02/2031, FLR jusqu'au 4/02/2032		461 000	376 303	0,39
JPMorgan Chase & Co., 3,109 % jusqu'au 22/04/2050, FLR jusqu'au 22/04/2051		666 000	475 140	0,49
Lloyds Banking Group PLC, 4,75 % jusqu'au 21/09/2030, FLR jusqu'au 21/09/2031	EUR	220 000	249 361	0,26
mBank S.A., 8,375 % jusqu'au 11/09/2026, FLR jusqu'au 11/09/2027		300 000	342 009	0,35
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,494 % jusqu'au 13/10/2031, FLR jusqu'au 13/10/2032	USD	450 000	376 743	0,39
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		150 000	143 944	0,15
Morgan Stanley, 1,593 % jusqu'au 4/05/2026, FLR jusqu'au 4/05/2027		548 000	507 498	0,53
Morgan Stanley, 3,622 % jusqu'au 1/04/2030, FLR jusqu'au 1/04/2031		286 000	263 880	0,27
Morgan Stanley, 5,424 % jusqu'au 21/07/2033, FLR jusqu'au 21/07/2034		180 000	182 332	0,19
PNC Financial Services Group, Inc., 5,3 % jusqu'au 21/01/2027, FLR jusqu'au 21/01/2028		198 000	199 753	0,21
PNC Financial Services Group, Inc., 5,676 % jusqu'au 22/01/2034, FLR jusqu'au 22/01/2035		291 000	298 624	0,31
Société Générale S.A., 5,625 %, 2/06/2033	EUR	200 000	230 192	0,24
UBS Group AG, 2,746 % jusqu'au 11/02/2032, FLR jusqu'au 11/02/2033	USD	810 000	664 053	0,69
UBS Group AG, 4,125 % jusqu'au 9/06/2032, FLR jusqu'au 9/06/2033	EUR	280 000	305 885	0,32
UBS Group AG, 9,25 % jusqu'au 13/11/2028, FLR jusqu'au 13/05/2172	USD	221 000	236 401	0,24
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026		430 000	407 356	0,42
UniCredit S.p.A., 4,3 %, 23/01/2031	EUR	600 000	651 980	0,68
UniCredit S.p.A., 5,375 %, 16/04/2034		390 000	425 330	0,44
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033	USD	373 000	327 397	0,34
			11 375 791	11,78

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance Corp., 3,8 %, 23/09/2049	USD	464 000	368 822	0,38
CVS Health Corp., 5,625 %, 21/02/2053		232 000	231 004	0,24
HCA, Inc., 5,25 %, 15/06/2026		171 000	171 490	0,18
HCA, Inc., 5,125 %, 15/06/2039		194 000	185 769	0,19
IQVIA, Inc., 6,25 %, 1/02/2029		258 000	268 505	0,28
New York Society for the Relief of the Ruptured & Crippled, 2,667 %, 1/10/2050		350 000	216 711	0,22
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 6,015 %, 15/11/2048		102 000	107 491	0,11
Thermo Fisher Scientific (Finance I) B.V., 2 %, 18/10/2051	EUR	360 000	274 882	0,29
Thermo Fisher Scientific, Inc., 4,977 %, 10/08/2030	USD	265 000	270 901	0,28
			2 095 575	2,17
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 5,625 %, 1/04/2030		264 000	267 701	0,28
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031		326 000	281 772	0,29
			549 473	0,57
Secteur intermédiaire				
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 5,927 %, 15/08/2030		342 000	355 504	0,37
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 6,036 %, 15/11/2033		181 000	190 025	0,20
Enbridge, Inc., 5,7 %, 8/03/2033		216 000	222 834	0,23
Enbridge, Inc., 8,5 % jusqu'au 15/01/2034, FLR jusqu'au 15/01/2084		299 000	319 660	0,33
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028		170 000	172 992	0,18
Energy Transfer LP, 5,95 %, 15/05/2054		254 000	254 722	0,26
Energy Transfer LP, 7,125 % jusqu'au 15/05/2030, FLR jusqu'au 15/05/2171		264 000	255 196	0,26
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,16 %, 31/03/2034		399 237	342 650	0,36
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		150 000	137 312	0,14
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		243 000	211 921	0,22
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15/08/2031		279 000	246 726	0,26
Venture Global LNG, Inc., 9,5 %, 1/02/2029		112 000	118 948	0,12
			2 828 490	2,93
Obligations municipales				
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, Issue M, "A", 2,641 %, 1/07/2037		150 000	130 188	0,14
Michigan Finance Authority Hospital Rev., Taxable (Trinity Health Credit Group), 3,384 %, 1/12/2040		270 000	220 210	0,23
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), "C", 5,45 %, 15/08/2028		154 000	138 882	0,14
			489 280	0,51
Gaz naturel - Distribution				
ENGIE S.A., 4,5 %, 6/09/2042	EUR	100 000	114 584	0,12
ENGIE S.A., 4,25 %, 11/01/2043		200 000	222 270	0,23
			336 854	0,35
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 0,75 %, 15/03/2029		300 000	283 042	0,29
APA Infrastructure Ltd., 2,5 %, 15/03/2036	GBP	660 000	600 546	0,62
APA Infrastructure Ltd., 7,125 % jusqu'au 9/02/2029, FLR jusqu'au 9/11/2083	EUR	220 000	254 095	0,27
			1 137 683	1,18
Services pétroliers				
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 5,25 %, 23/01/2084		100 000	109 760	0,11
Pétrole				
Neste Oyj, 3,875 %, 21/05/2031		110 000	122 506	0,13
Puma International Financing S.A., 5 %, 24/01/2026	USD	259 000	245 314	0,25
			367 820	0,38
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
ABANCA Corp. Bancaria S.A., 5,875 % jusqu'au 2/04/2029, FLR jusqu'au 2/04/2030	EUR	400 000	462 505	0,48
ABANCA Corp. Bancaria S.A., 8,375 % jusqu'au 23/09/2028, FLR jusqu'au 23/09/2033		500 000	589 560	0,61
AIB Group PLC, 6,608 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2029	USD	600 000	630 333	0,65

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Autres banques et établissements financiers diversifiés, suite				
AIB Group PLC, 5,25 %, 23/10/2031	EUR	290 000	335 185	0,35
Alpha Bank, 4,25 %, 13/02/2030		210 000	221 273	0,23
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 4,375 %, 11/01/2034		300 000	320 968	0,33
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 3,75 %, 3/02/2034		200 000	217 034	0,23
BBVA Bancomer S.A., 8,45 % jusqu'au 29/06/2033, FLR jusqu'au 29/06/2038	USD	400 000	417 534	0,43
BPCE S.A., 4,5 %, 15/03/2025		464 000	456 685	0,47
BPCE S.A., 2,277 % jusqu'au 20/01/2031, FLR jusqu'au 20/01/2032		650 000	523 931	0,54
BPCE S.A., 4,75 % jusqu'au 14/06/2033, FLR jusqu'au 14/06/2034	EUR	200 000	229 729	0,24
BPCE S.A., 4,25 % jusqu'au 11/01/2034, FLR jusqu'au 11/01/2035		400 000	440 842	0,46
CaixaBank S.A., 5 % jusqu'au 19/07/2028, FLR jusqu'au 19/07/2029		200 000	226 087	0,23
CaixaBank S.A., 8,25 % jusqu'au 13/09/2029, FLR jusqu'au 13/06/2172		200 000	228 568	0,24
Commerzbank AG, 4,625 %, 17/01/2031		100 000	110 476	0,11
Deutsche Bank AG, 3,75 % jusqu'au 15/01/2029, FLR jusqu'au 15/01/2030		300 000	325 774	0,34
Deutsche Bank AG, 6,125 % jusqu'au 12/12/2029, FLR jusqu'au 12/12/2030	GBP	300 000	382 887	0,40
Deutsche Bank AG, 4 % jusqu'au 24/06/2027, FLR jusqu'au 24/06/2032	EUR	300 000	312 644	0,32
Deutsche Bank AG, 10 % jusqu'au 30/04/2028, FLR jusqu'au 14/11/2171		200 000	233 170	0,24
Intesa Sanpaolo S.p.A., 5,125 %, 29/08/2031		400 000	466 060	0,48
Intesa Sanpaolo S.p.A., 7,2 %, 28/11/2033	USD	422 000	452 102	0,47
KBC Group N.V., 4,75 %, 17/04/2035	EUR	400 000	435 150	0,45
M&T Bank Corp., 4,553 % jusqu'au 16/08/2027, FLR jusqu'au 16/08/2028	USD	97 000	93 638	0,10
Macquarie Group Ltd., 6,255 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2034		248 000	260 530	0,27
Manufacturers and Traders Trust Co., 4,7 %, 27/01/2028		278 000	272 479	0,28
Truist Financial Corp., 5,711 % jusqu'au 24/01/2034, FLR jusqu'au 24/01/2035		170 000	172 866	0,18
Virgin Money UK PLC, 7,625 %, 23/08/2029	GBP	280 000	378 810	0,39
Virgin Money UK PLC, 11 % jusqu'au 8/06/2029, FLR jusqu'au 8/06/2172		400 000	518 597	0,54
			9 715 417	10,06
Produits pharmaceutiques				
Bayer US Finance LLC, 6,375 %, 21/11/2030	USD	586 000	598 169	0,62
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 4,75 %, 19/05/2033		360 000	359 554	0,37
Roche Holdings, Inc., 5,489 %, 13/11/2030		540 000	569 021	0,59
			1 526 744	1,58
Lutte contre la pollution				
GFL Environmental, Inc., 3,5 %, 1/09/2028		139 000	125 823	0,13
GFL Environmental, Inc., 6,75 %, 15/01/2031		190 000	194 328	0,20
Waste Management, Inc., 4,625 %, 15/02/2033		369 000	366 357	0,38
			686 508	0,71
Métaux et minéraux précieux				
Northern Star Resources Ltd. Co., 6,125 %, 11/04/2033		326 000	332 265	0,34
Immobilier - Bureaux				
Boston Properties LP, REIT, 3,65 %, 1/02/2026		297 000	286 830	0,30
Corporate Office Property LP, REIT, 2,25 %, 15/03/2026		81 000	76 097	0,08
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		443 000	372 198	0,38
Corporate Office Property LP, REIT, 2,75 %, 15/04/2031		210 000	171 443	0,18
			906 568	0,94
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		451 000	377 201	0,39
Extra Space Storage LP, 5,5 %, 1/07/2030		401 000	410 082	0,43
Lexington Realty Trust Co., REIT, 2,7 %, 15/09/2030		312 000	262 483	0,27
			1 049 766	1,09
Immobilier - Distribution				
STORE Capital Corp., REIT, 2,75 %, 18/11/2030		439 000	348 930	0,36
STORE Capital Corp., REIT, 2,7 %, 1/12/2031		142 000	111 278	0,12
WEA Finance LLC, 2,875 %, 15/01/2027		320 000	289 397	0,30
			749 605	0,78

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Restaurants				
McDonald's Corp., 3,875 %, 20/02/2031	EUR	270 000	302 249	0,31
Distribution				
B&M EuropeanValue Retail S.A., 8,125 %, 15/11/2030	GBP	100 000	134 492	0,14
Home Depot, Inc., 4,875 %, 15/02/2044	USD	206 000	202 079	0,21
Home Depot, Inc., 3,625 %, 15/04/2052		163 000	128 936	0,13
			465 507	0,48
Produits chimiques spéciaux				
Covestro AG, 1,375 %, 12/06/2030	EUR	320 000	306 815	0,32
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027	USD	290 000	256 957	0,27
International Flavors & Fragrances, Inc., 4,375 %, 1/06/2047		264 000	205 136	0,21
			768 908	0,80
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		277 000	235 523	0,24
Télécommunications mobiles				
Cellnex Finance Co. S.A., 2 %, 15/02/2033	EUR	200 000	185 777	0,19
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032	USD	386 000	351 101	0,37
T-Mobile USA, Inc., 3,875 %, 15/04/2030		442 000	418 000	0,43
T-Mobile USA, Inc., 5,75 %, 15/01/2034		219 000	230 730	0,24
Vodafone Group PLC, 3,375 %, 8/08/2049	GBP	280 000	242 884	0,25
Vodafone Group PLC, 5,625 %, 10/02/2053	USD	278 000	280 060	0,29
			1 708 552	1,77
Services téléphoniques				
Deutsche Telekom AG, 1,375 %, 5/07/2034	EUR	410 000	381 297	0,40
TELUS Corp., 2,85 %, 13/11/2031	CAD	630 000	408 280	0,42
			789 577	0,82
Tabac				
B.A.T. International Finance PLC, 2,25 %, 16/01/2030	EUR	260 000	252 496	0,26
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 17/11/2027	USD	267 000	271 370	0,28
			523 866	0,54
Transports - Services				
Aeroporti di Roma S.p.A., 4,875 %, 10/07/2033	EUR	410 000	465 960	0,48
Autostrade per l'Italia S.p.A., 5,125 %, 14/06/2033		140 000	158 887	0,16
Autostrade per l'Italia S.p.A., 4,75 %, 24/01/2031		215 000	240 612	0,25
Element Fleet Management Corp., 6,271 %, 26/06/2026	USD	252 000	256 555	0,27
Element Fleet Management Corp., 6,319 %, 4/12/2028		439 000	456 202	0,47
Transurban Finance Co. Pty Ltd., 4,225 %, 26/04/2033	EUR	130 000	147 226	0,15
Triton International Ltd., 3,15 %, 15/06/2031	USD	394 000	316 533	0,33
United Parcel Service, 5,05 %, 3/03/2053		455 000	460 347	0,48
			2 502 322	2,59
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 4,375 %, 15/08/2043		274 000	275 970	0,28
Obligations du Trésor américain, 3,625 %, 15/05/2053		492 000	442 108	0,46
			718 078	0,74
Services publics - Énergie électrique				
American Electric Power Co., Inc., 5,699 %, 15/08/2025		83 000	83 638	0,09
American Electric Power Co., Inc., 5,625 %, 1/03/2033		205 000	211 493	0,22
American Transmission Systems, Inc., 2,65 %, 15/01/2032		85 000	71 456	0,07
Berkshire Hathaway Energy Co., 5,15 %, 15/11/2043		75 000	74 328	0,08
Berkshire Hathaway Energy Co., 4,6 %, 1/05/2053		63 000	55 651	0,06
Bruce Power LP, 2,68 %, 21/12/2028	CAD	610 000	416 190	0,43
Duke Energy Florida LLC, 6,2 %, 15/11/2053	USD	233 000	260 741	0,27
E.ON International Finance B.V., 5,875 %, 30/10/2037	GBP	450 000	592 307	0,61
Enel Finance International N.V., 3,875 %, 23/01/2035	EUR	380 000	415 758	0,43
Enel Finance International N.V., 4,5 %, 20/02/2043		170 000	189 969	0,20
Enel Finance International N.V., 4,75 %, 25/05/2047	USD	464 000	405 628	0,42

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Credit Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services publics - Énergie électrique, suite				
EPH Financing International A.S., 6,651 %, 13/11/2028	EUR	467 000	515 697	0,53
Eversource Energy, 5,5 %, 1/01/2034	USD	253 000	255 899	0,26
Georgia Power Co., 4,95 %, 17/05/2033		454 000	454 148	0,47
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		152 000	128 112	0,13
Mercury Chile Holdco LLC, 6,5 %, 24/01/2027		380 000	353 377	0,37
National Grid Electricity Transmission PLC, 2 %, 17/04/2040	GBP	340 000	271 989	0,28
National Grid PLC, 4,275 %, 16/01/2035	EUR	150 000	166 260	0,17
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 6,051 %, 1/03/2025	USD	161 000	162 357	0,17
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 5,749 %, 1/09/2025		178 000	179 798	0,19
Pacific Gas & Electric Co., 6,1 %, 15/01/2029		259 000	268 336	0,28
Pacific Gas & Electric Co., 6,4 %, 15/06/2033		156 000	165 603	0,17
PPL Electric Utilities Corp, 1st Mortgage, 5,25 %, 15/05/2053		421 000	424 179	0,44
SSE PLC, 4 %, 5/09/2031	EUR	185 000	207 835	0,22
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032	USD	282 000	273 582	0,28
			6 604 331	6,84
Services publics - Gaz				
EP Infrastructure A.S., 1,698 %, 30/07/2026	EUR	450 000	443 694	0,46
EP Infrastructure A.S., 2,045 %, 9/10/2028		480 000	441 460	0,46
			885 154	0,92
Services publics - Autres				
Aegea Finance S.à r.l., 9 %, 20/01/2031	USD	368 000	387 044	0,40
Total des obligations (coût identifié, 93 194 985 \$)			91 493 335	94,77
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 262 000 \$)	USD	262 000	261 962	0,27
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 93 456 985 \$)			91 755 297	95,04

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS D'ACHAT ACHETÉES				
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3,5 %	11 146 063	9 580 000	115 971	0,12
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3,5 %	5 270 529	4 530 000	54 838	0,06
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3 %	21 489 331	18 470 000	49 558	0,05
Total des Options d'Achat Achetées (primes versées, 151 826 \$)			220 367	0,23
Total des investissements (coût identifié, 93 608 811 \$) (k)			91 975 664	95,27
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			4 561 907	4,73
ACTIF NET			96 537 571	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Global Equity Fund

(en dollars US)

Nom du titre

Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé

ACTIONS ORDINAIRES

Aérospatiale et défense

	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Honeywell International, Inc.	316 504	64 016 099	2,06
MTU Aero Engines Holding AG	60 785	14 038 030	0,45

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Aérospatiale et défense, suite			
Rolls-Royce Holdings PLC	6 310 417	23 983 054	0,77
		102 037 183	3,28
Compagnies aériennes			
Aena SME S.A.	160 410	28 391 489	0,91
Boissons alcoolisées			
Carlsberg A.S., "B"	137 872	17 732 812	0,57
Diageo PLC	1 722 629	61 957 462	1,99
Heineken N.V.	541 549	54 503 715	1,75
Pernod Ricard S.A.	256 807	42 265 933	1,36
		176 459 922	5,67
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	1 157 025	19 179 178	0,62
Compagnie Financiere Richemont S.A.	392 296	58 643 240	1,88
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	80 387	66 857 926	2,15
		144 680 344	4,65
Industrie automobile			
Aptiv PLC	209 975	17 077 267	0,55
Radio-télévision			
Omnicom Group, Inc.	99 073	8 954 218	0,29
Walt Disney Co.	362 971	34 863 364	1,12
WPP Group PLC	1 742 571	16 897 733	0,54
		60 715 315	1,95
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Charles Schwab Corp.	992 151	62 426 141	2,00
Deutsche Boerse AG	85 769	17 124 584	0,55
London Stock Exchange Group PLC	213 208	24 131 073	0,78
		103 681 798	3,33
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	228 305	83 075 624	2,67
Adecco S.A.	191 130	8 279 929	0,27
Brenntag AG	177 321	15 763 553	0,51
Cognizant Technology Solutions Corp., "A"	437 686	33 754 344	1,08
Compass Group PLC	667 694	18 429 556	0,59
Equifax, Inc.	81 539	19 923 239	0,64
Experian PLC	858 130	35 776 171	1,15
Fidelity National Information Services, Inc.	405 842	25 267 723	0,81
Fiserv, Inc.	230 953	32 765 302	1,05
Intertek Group PLC	357 609	20 288 881	0,65
PayPal Holdings, Inc.	142 538	8 744 706	0,28
TransUnion	338 061	23 390 441	0,75
		325 459 469	10,45
Télévision par câble			
Comcast Corp., "A"	1 678 592	78 121 672	2,51
Produits chimiques			
3M Co.	230 258	21 724 842	0,70
PPG Industries, Inc.	225 991	31 873 771	1,02
		53 598 613	1,72
Logiciels			
Check Point Software Technologies Ltd.	253 204	40 241 712	1,29
Oracle Corp.	520 261	58 113 153	1,87
		98 354 865	3,16
Logiciels - Systèmes			
Samsung Electronics Co. Ltd.	618 225	33 523 082	1,08
Construction			
Otis Worldwide Corp.	209 355	18 515 356	0,59

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Biens de consommation			
Essity AB	1 434 486	33 730 233	1,08
International Flavors & Fragrances, Inc.	468 308	37 783 089	1,22
Reckitt Benckiser Group PLC	509 409	36 785 549	1,18
		108 298 871	3,48
Équipements électriques			
Amphenol Corp., "A"	254 180	25 697 598	0,82
Legrand S.A.	393 179	38 232 558	1,23
Schneider Electric SE	467 763	92 190 308	2,96
		156 120 464	5,01
Électronique			
Hoya Corp.	124 700	15 817 812	0,51
Microchip Technology, Inc.	208 869	17 791 462	0,57
		33 609 274	1,08
Alimentation et boissons			
Danone S.A.	217 595	14 518 467	0,47
Nestlé S.A.	536 301	61 148 288	1,96
		75 666 755	2,43
Jeux et hôtellerie			
Marriott International, Inc., "A"	99 732	23 908 753	0,77
Whitbread PLC	336 187	15 255 609	0,49
		39 164 362	1,26
Assurances			
Aon PLC	126 404	37 722 746	1,21
Willis Towers Watson PLC	259 625	63 945 637	2,05
		101 668 383	3,26
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	457 145	64 046 014	2,05
eBay, Inc.	461 158	18 939 759	0,61
		82 985 773	2,66
Machines et outils			
Carrier Global Corp.	175 137	9 581 745	0,31
Kubota Corp.	1 936 300	29 400 730	0,94
		38 982 475	1,25
Grandes banques			
Erste Group Bank AG	431 878	18 692 562	0,60
Goldman Sachs Group, Inc.	152 794	58 674 424	1,88
UBS Group AG	2 073 282	61 922 049	1,99
		139 289 035	4,47
Équipements médicaux			
Abbott Laboratories	371 388	42 022 552	1,35
Becton, Dickinson and Co.	100 065	23 896 523	0,77
Boston Scientific Corp.	846 628	53 557 687	1,72
Cooper Cos., Inc.	76 223	28 433 466	0,91
EssilorLuxottica	68 015	13 372 238	0,43
Medtronic PLC	897 137	78 535 373	2,52
Olympus Corp.	2 352 500	34 853 747	1,12
Sonova Holding AG	59 174	18 883 412	0,61
Stryker Corp.	69 671	23 373 227	0,75
Thermo Fisher Scientific, Inc.	141 948	76 507 133	2,46
Waters Corp.	134 864	42 847 641	1,37
		436 282 999	14,01
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
American Express Co.	229 633	46 096 528	1,48
Grupo Financiero Banorte S.A. de C.V.	1 069 881	10 881 874	0,35
Julius Baer Group Ltd.	203 468	11 111 755	0,36

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Autres banques et établissements financiers diversifiés, suite			
Visa, Inc., "A"	355 067	97 025 609	3,11
		165 115 766	5,30
Produits pharmaceutiques			
Merck KGaA	306 505	50 480 978	1,62
Roche Holding AG	235 663	67 333 090	2,16
		117 814 068	3,78
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian National Railway Co.	398 007	49 368 788	1,58
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	738 880	59 457 674	1,91
Union Pacific Corp.	163 390	39 855 723	1,28
		148 682 185	4,77
Produits chimiques spéciaux			
Air Liquide S.A.	162 735	30 502 864	0,98
Akzo Nobel N.V.	347 223	26 575 007	0,85
Linde PLC	201 481	81 565 553	2,62
		138 643 424	4,45
Magasins spécialisés			
Hermes International	6 581	13 891 798	0,45
Télécommunications mobiles			
Cellnex Telecom S.A.	570 341	21 961 318	0,71
Liberty Broadband Corp.	402 450	31 572 202	1,01
		53 533 520	1,72
Transport par camion			
United Parcel Service, Inc., "B"	162 197	23 015 754	0,74
Total des actions ordinaires (coût identifié, 2 349 308 344 \$)		3 113 381 281	99,97
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)			
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 995 000 \$)	USD 995 000	994 856	0,03
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 350 303 344 \$) (k)		3 114 376 137	100,00
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		(96 586)	(0,00)
ACTIF NET		3 114 279 551	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Global Equity Income Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
General Dynamics Corp.	543	143 890	2,10
Boissons alcoolisées			
Ambev S.A.	7 500	19 800	0,29
Kirin Holdings Co. Ltd.	4 800	69 376	1,01
		89 176	1,30
Industrie automobile			
Bridgestone Corp.	1 400	60 858	0,89
Stellantis N.V.	2 318	51 062	0,75
Tofas Turk Otomobil Fabrikasi A.S.	1 806	14 665	0,21
		126 585	1,85
Biotechnologies			
Biogen, Inc.	64	15 786	0,23

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Equity Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Radio-télévision			
Omnicom Group, Inc.	1 568	141 716	2,07
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Bank of New York Mellon Corp.	2 436	135 101	1,97
Services aux entreprises			
SCSK Corp.	1 100	21 630	0,31
TriNet Group, Inc.	206	23 422	0,34
Verisk Analytics, Inc., "A"	118	28 501	0,42
		73 553	1,07
Télévision par câble			
Comcast Corp., "A"	2 899	134 919	1,97
Produits chimiques			
Nutrien Ltd.	217	10 821	0,16
Logiciels			
Microsoft Corp.	113	44 927	0,66
Logiciels - Systèmes			
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	36 000	117 424	1,71
Lenovo Group Ltd.	44 000	45 528	0,67
Samsung Electronics Co. Ltd.	1 046	56 719	0,83
Seagate Technology Holdings PLC	211	18 078	0,26
		237 749	3,47
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	18 000	36 102	0,53
Compagnie de Saint-Gobain S.A.	1 017	72 018	1,05
Heidelberg Materials AG	826	76 662	1,12
Zhejiang Supor Co. Ltd., "A"	2 600	18 342	0,27
		203 124	2,97
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	1 526	128 489	1,88
Kenvue, Inc.	891	18 497	0,27
Kimberly-Clark Corp.	1 587	191 980	2,80
Procter & Gamble Co.	99	15 557	0,23
		354 523	5,18
Équipements électriques			
Mitsubishi Electric Corp.	1 700	25 035	0,36
Électronique			
Broadcom, Inc.	36	42 480	0,62
Lam Research Corp.	101	83 342	1,22
Novatek Microelectronics Corp.	3 000	48 703	0,71
NVIDIA Corp.	67	41 223	0,60
		215 748	3,15
Énergie - Sociétés indépendantes			
Phillips 66	1 458	210 404	3,07
Valero Energy Corp.	581	80 701	1,18
		291 105	4,25
Énergie - Sociétés intégrées			
Aker BP ASA	1 079	28 615	0,42
Eni S.p.A.	6 500	103 964	1,52
Exxon Mobil Corp.	300	30 843	0,45
LUKOIL PJSC (c)	73	0	0,00
PetroChina Co. Ltd.	142 000	101 718	1,49
Suncor Energy, Inc.	1 348	44 638	0,65
TotalEnergies SE	1 549	100 883	1,47
		410 661	6,00
Ingénierie - Construction			
ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.	509	20 094	0,29

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Equity Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Ingénierie - Construction, suite			
Doosan Bobcat, Inc.	1 000	37 612	0,55
		57 706	0,84
Alimentation et boissons			
Archer Daniels Midland Co.	669	37 183	0,54
General Mills, Inc.	2 455	159 354	2,33
J.M. Smucker Co.	338	44 464	0,65
WH Group Ltd.	19 500	11 474	0,17
		252 475	3,69
Magasins d'alimentation et pharmacies			
BIM Birlesik Magazalar A.S.	2 993	37 579	0,55
Tesco PLC	30 333	110 051	1,61
Wesfarmers Ltd.	619	23 551	0,34
		171 181	2,50
Produits forestiers et papier			
Weyerhaeuser Co., REIT	838	27 461	0,40
Jeux et hôtellerie			
Aristocrat Leisure Ltd.	675	19 455	0,28
Organisations de soins de santé intégrés			
Cigna Group	354	106 536	1,55
Assurances			
China Pacific Insurance Co. Ltd.	6 600	12 089	0,18
DB Insurance Co. Ltd.	276	18 059	0,26
Equitable Holdings, Inc.	3 999	130 727	1,91
Hartford Financial Services Group, Inc.	557	48 437	0,71
Manulife Financial Corp.	8 548	188 959	2,76
MetLife, Inc.	1 144	79 302	1,16
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	411	81 053	1,18
		558 626	8,16
Machines et outils			
Timken Co.	202	16 546	0,24
Volvo Group	3 512	83 869	1,23
		100 415	1,47
Grandes banques			
ABN AMRO Group N.V., GDR	2 642	39 070	0,57
BNP Paribas	1 309	88 018	1,28
DBS Group Holdings Ltd.	6 700	158 642	2,32
Erste Group Bank AG	644	27 874	0,41
		313 604	4,58
Technologies et services médicaux et de santé			
McKesson Corp.	225	112 475	1,64
Métaux et exploitation minière			
Fortescue Ltd.	1 079	20 965	0,31
Glencore PLC	3 875	20 647	0,30
Rio Tinto PLC	2 745	191 435	2,79
Toyota Tsusho Corp.	500	32 728	0,48
Vale S.A.	3 300	45 133	0,66
		310 908	4,54
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
China Construction Bank Corp.	53 000	31 414	0,46
KB Financial Group, Inc.	419	17 769	0,26
M&T Bank Corp.	255	35 215	0,51
Sberbank of Russia PJSC (c)	7 088	0	0,00
		84 398	1,23
Produits pharmaceutiques			
AbbVie, Inc.	1 211	199 088	2,91

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Equity Income Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Produits pharmaceutiques, suite			
Johnson & Johnson	837	132 999	1,94
Merck & Co., Inc.	239	28 867	0,42
Novartis AG	928	96 139	1,40
Organon & Co.	6 581	109 574	1,60
Pfizer, Inc.	1 110	30 059	0,44
Roche Holding AG	697	199 145	2,91
Sanofi	469	47 093	0,69
		842 964	12,31
Immobilier			
Brixmor Property Group, Inc., REIT	1 285	28 835	0,42
Broadstone Net Lease, Inc., REIT	596	9 578	0,14
NNN REIT, Inc.	699	28 198	0,41
		66 611	0,97
Restaurants			
Sodexo	961	108 633	1,59
Texas Roadhouse, Inc.	174	21 875	0,32
		130 508	1,91
Produits chimiques spéciaux			
Chemours Co.	581	17 529	0,26
Magasins spécialisés			
Home Depot, Inc.	174	61 415	0,90
Ross Stores, Inc.	252	35 351	0,51
Target Corp.	619	86 090	1,26
		182 856	2,67
Télécommunications mobiles			
KDDI Corp.	5 000	165 447	2,42
Services téléphoniques			
Hellenic Telecommunications Organization S.A.	3 065	42 564	0,62
Tabac			
British American Tobacco PLC	2 990	88 293	1,29
Japan Tobacco, Inc.	3 900	102 802	1,50
		191 095	2,79
Services publics - Énergie électrique			
Edison International	1 807	121 936	1,78
Iberdrola S.A.	4 454	53 663	0,78
PG&E Corp.	1 610	27 161	0,40
Vistra Corp.	680	27 900	0,41
		230 660	3,37
Total des actions ordinaires (coût identifié, 6 524 439 \$)		6 639 893	96,96
ACTIONS PRIVILÉGIÉES			
Métaux et exploitation minière			
Gerdau S.A. (coût identifié, 81 313 \$)	16 080	68 287	1,00
OBLIGATIONS CONVERTIBLES			
Services publics - Énergie électrique			
Pacific Gas and Electric Corp., 4,25 %, 1/12/2027 (coût identifié, 10 000 \$)	USD 10 000	10 175	0,15
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 6 615 752 \$) (k)		6 718 355	98,11
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		129 287	1,89
ACTIF NET		6 847 642	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
Bombardier, Inc., 7,125 %, 15/06/2026	USD	239 000	240 992	0,10
Bombardier, Inc., 7,5 %, 1/02/2029		232 000	236 468	0,10
Bombardier, Inc., 8,75 %, 15/11/2030		161 000	168 963	0,07
F-Brasile S.p.A./F-Brasile U.S. LLC, 7,375 %, 15/08/2026		465 000	459 769	0,20
Moog, Inc., 4,25 %, 15/12/2027		545 000	510 294	0,22
Spirit AeroSystems, Inc., 9,75 %, 15/11/2030		746 000	782 972	0,33
TransDigm, Inc., 6,25 %, 15/03/2026		490 000	486 667	0,21
TransDigm, Inc., 5,5 %, 15/11/2027		538 000	523 425	0,22
TransDigm, Inc., 6,75 %, 15/08/2028		456 000	463 462	0,20
TransDigm, Inc., 4,625 %, 15/01/2029		520 000	486 236	0,21
TransDigm, Inc., 6,875 %, 15/12/2030		930 000	951 771	0,40
			5 311 019	2,26
Compagnies aériennes				
Air Canada, 3,875 %, 15/08/2026		770 000	732 330	0,31
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd., 5,75 %, 20/04/2029		512 207	503 003	0,22
			1 235 333	0,53
Industrie de la confection				
Wolverine World Wide, Inc., 4 %, 15/08/2029		372 000	299 758	0,13
Créances adossées à des actifs et titrisées				
COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust, 2006-2A, "F", CDO, FLR, 5,626 %, 26/04/2050 (p)		703 313	70	0,00
Industrie automobile				
Clarios Global LP/Clarios U.S. Finance Co., 8,5 %, 15/05/2027		482 000	480 679	0,20
Clarios Global LP/Clarios U.S. Finance Co., 6,75 %, 15/05/2028		223 000	225 959	0,10
Dana, Inc., 5,375 %, 15/11/2027		440 000	429 396	0,18
Dana, Inc., 4,25 %, 1/09/2030		249 000	217 718	0,09
Dornoch Debt Merger Sub, Inc., 6,625 %, 15/10/2029		461 000	418 458	0,18
RAC Bond Co. PLC, 5,25 %, 4/11/2027	GBP	901 000	1 056 750	0,45
Real Hero Merger Sub 2, Inc., 6,25 %, 1/02/2029	USD	378 000	327 938	0,14
Wabash National Corp., 4,5 %, 15/10/2028		512 000	465 920	0,20
			3 622 818	1,54
Industries de base				
PeopleCert Wisdom, 5,75 %, 15/09/2026	EUR	715 000	759 178	0,32
Radio-télévision				
AMC Networks, Inc., 4,75 %, 1/08/2025	USD	140 000	134 894	0,06
Banjay Entertainment S.A.S.U., 7 %, 1/05/2029	EUR	542 000	616 063	0,26
Banjay Group S.A.S., 8,125 %, 1/05/2029	USD	500 000	516 999	0,22
Midas OpCo Holdings LLC, 5,625 %, 15/08/2029		633 000	579 233	0,25
WMG Acquisition Corp., 2,25 %, 15/08/2031	EUR	687 000	638 499	0,27
			2 485 688	1,06
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
AG TTMT Escrow Issuer LLC, 8,625 %, 30/09/2027	USD	415 000	430 827	0,18
Aretec Escrow Issuer 2, Inc., 10 %, 15/08/2030		461 000	497 890	0,21
Aretec Escrow Issuer, Inc., 7,5 %, 1/04/2029		405 000	376 983	0,16
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		323 000	297 683	0,13
LPL Holdings, Inc., 4,375 %, 15/05/2031		454 000	412 681	0,18
NFP Corp., 4,875 %, 15/08/2028		505 000	500 910	0,21
NFP Corp., 6,875 %, 15/08/2028		396 000	398 220	0,17
			2 915 194	1,24
Construction				
ABC Supply Co., Inc., 3,875 %, 15/11/2029		300 000	267 314	0,11
Foundation Construction Materials LLC, 6 %, 1/03/2029		556 000	488 585	0,21
GYP Holding III Corp., 4,625 %, 1/05/2029		707 000	654 901	0,28
HT Troplast GmbH, 9,375 %, 15/07/2028	EUR	707 000	784 367	0,33
Interface, Inc., 5,5 %, 1/12/2028	USD	546 000	510 969	0,22
MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Co., 5,5 %, 1/02/2030		458 000	416 780	0,18

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Construction, suite				
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 5,25 %, 15/07/2028	USD	595 000	571 676	0,24
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 9,75 %, 15/07/2028		189 000	190 010	0,08
Patrick Industries, Inc., 7,5 %, 15/10/2027		633 000	636 165	0,27
SRM Concrete, 8,875 %, 15/11/2031		638 000	670 258	0,29
Standard Industries, Inc., 2,25 %, 21/11/2026	EUR	500 000	506 406	0,22
Standard Industries, Inc., 4,75 %, 15/01/2028	USD	291 000	278 319	0,12
Standard Industries, Inc., 4,375 %, 15/07/2030		701 000	637 035	0,27
White Cap Buyer LLC, 6,875 %, 15/10/2028		561 000	549 118	0,23
			7 161 903	3,05
Services aux entreprises				
Engineering Ingegneria Informatica S.p.A., 11,125 %, 15/05/2028	EUR	528 000	613 405	0,26
Entegris Escrow Corp., 5,95 %, 15/06/2030	USD	305 000	301 272	0,13
Iron Mountain, Inc., 4,875 %, 15/09/2027		415 000	401 018	0,17
Iron Mountain, Inc., 5,25 %, 15/03/2028		426 000	413 138	0,18
Nexi S.p.A., 2,125 %, 30/04/2029	EUR	1 440 000	1 373 665	0,58
Verscend Escrow Corp., 9,75 %, 15/08/2026	USD	762 000	765 037	0,32
			3 867 535	1,64
Télévision par câble				
Cable One, Inc., 4 %, 15/11/2030		856 000	689 080	0,29
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 5,125 %, 1/05/2027		327 000	315 397	0,13
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,75 %, 1/03/2030		1 767 000	1 570 169	0,67
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,5 %, 15/08/2030		953 000	828 786	0,35
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,25 %, 1/02/2031		489 000	413 472	0,18
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,25 %, 15/01/2034		366 000	291 008	0,12
CSC Holdings LLC, 5,375 %, 1/02/2028		810 000	695 859	0,30
CSC Holdings LLC, 7,5 %, 1/04/2028		200 000	133 136	0,06
CSC Holdings LLC, 11,75 %, 31/01/2029		200 000	203 146	0,09
CSC Holdings LLC, 5,75 %, 15/01/2030		600 000	317 574	0,14
CSC Holdings LLC, 4,125 %, 1/12/2030		200 000	144 500	0,06
DIRECTV Financing LLC, 8,875 %, 1/02/2030		113 000	115 266	0,05
DISH DBS Corp., 7,75 %, 1/07/2026		250 000	147 306	0,06
DISH DBS Corp., 5,25 %, 1/12/2026		490 000	385 877	0,16
DISH DBS Corp., 5,125 %, 1/06/2029		396 000	151 687	0,07
DISH Network Corp., 11,75 %, 15/11/2027		210 000	219 178	0,09
LCPR Senior Secured Financing DAC, 6,75 %, 15/10/2027		668 000	643 459	0,27
LCPR Senior Secured Financing DAC, 5,125 %, 15/07/2029		210 000	184 813	0,08
Sirius XM Radio, Inc., 4 %, 15/07/2028		284 000	257 903	0,11
Sirius XM Radio, Inc., 5,5 %, 1/07/2029		915 000	869 250	0,37
Sirius XM Radio, Inc., 3,875 %, 1/09/2031		379 000	315 972	0,13
Summer BidCo B.V., 9 %, 15/11/2025 (p)	EUR	1 206 536	1 305 534	0,56
Summer BidCo B.V., 10 %, 15/02/2029 (p)		150 000	163 634	0,07
United Group B.V., 5,25 %, 1/02/2030		316 000	316 657	0,14
Videotron Ltd., 5,125 %, 15/04/2027	USD	351 000	345 735	0,15
Videotron Ltd., 3,625 %, 15/06/2029		317 000	289 247	0,12
Virgin Media Finance PLC, 5 %, 15/07/2030		900 000	803 799	0,34
Virgin Media Receivables Financing Notes II DAC Co., 4,875 %, 15/07/2028	GBP	530 000	612 898	0,26
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC, 5 %, 15/07/2028	USD	773 000	727 666	0,31
Ziggo Bond Finance B.V., 2,875 %, 15/01/2030	EUR	1 090 000	1 068 589	0,46
Ziggo Bond Finance B.V., 3,375 %, 28/02/2030		265 000	242 757	0,10
Ziggo Bond Finance B.V., 5,125 %, 28/02/2030	USD	1 205 000	1 016 616	0,43
			15 785 970	6,72
Produits chimiques				
Axalta Coating Systems Ltd., 4,75 %, 15/06/2027		376 000	361 941	0,15
Axalta Coating Systems Ltd., 3,375 %, 15/02/2029		312 000	277 255	0,12

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Produits chimiques, suite				
Element Solutions, Inc., 3,875 %, 1/09/2028	USD	488 000	445 813	0,19
LSF11 A5 HoldCo LLC, 6,625 %, 15/10/2029		559 000	473 270	0,20
Lune Holdings S.à r.l., 5,625 %, 15/11/2028	EUR	527 000	461 729	0,20
SCIH Salt Holdings, Inc., 6,625 %, 1/05/2029	USD	560 000	508 678	0,22
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC, 4,375 %, 1/11/2026	EUR	825 000	871 606	0,37
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC, 9,5 %, 15/07/2028		277 000	323 003	0,14
SNF Group SACA, 3,375 %, 15/03/2030	USD	818 000	702 552	0,30
SPCM S.A., 2,625 %, 1/02/2029	EUR	544 000	541 604	0,23
Windsor Holdings III, LLC, 8,5 %, 15/06/2030	USD	672 000	691 827	0,29
			5 659 278	2,41
Logiciels				
Central Parent LLC/CDK Global II LLC/CDK Financing Co., Inc., 8 %, 15/06/2029		465 000	477 239	0,20
Dun & Bradstreet Corp., 5 %, 15/12/2029		506 000	470 397	0,20
			947 636	0,40
Logiciels - Systèmes				
Fair Isaac Corp., 5,25 %, 15/05/2026		879 000	868 013	0,37
Sabre GBLB, Inc., 8,625 %, 1/06/2027		60 000	56 100	0,02
Sabre GBLB, Inc., 8,625 %, 1/06/2027		229 000	214 115	0,09
Sabre GBLB, Inc., 11,25 %, 15/12/2027		223 000	223 279	0,09
SS&C Technologies Holdings, Inc., 5,5 %, 30/09/2027		923 000	906 052	0,39
Virtusa Corp., 7,125 %, 15/12/2028		292 000	256 060	0,11
			2 523 619	1,07
Conglomérats				
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 30/06/2028		378 000	354 874	0,15
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 15/04/2029		911 000	843 877	0,36
Chart Industries, Inc., 9,5 %, 1/01/2031		311 000	331 690	0,14
Emerald Debt Merger, 6,625 %, 15/12/2030		660 000	666 646	0,28
Gates Global LLC, 6,25 %, 15/01/2026		389 000	389 039	0,17
Griffon Corp., 5,75 %, 1/03/2028		560 000	548 800	0,23
Grupo KUO S.A.B. de C.V., 5,75 %, 7/07/2027		1 145 000	1 031 923	0,44
Madison IAQ LLC, 5,875 %, 30/06/2029		483 000	429 189	0,18
Regal Rexnord Corp., 6,3 %, 15/02/2030		373 000	383 403	0,16
RENK AG, 5,75 %, 15/07/2025	EUR	990 000	1 067 330	0,45
SCC Power PLC, 8 % (8 % liquidités ou 4 % liquidités + 4 % PIK) jusqu'au 15/06/2024, 8 % Liquidités au 31/12/2028 (p)	USD	1 176 870	550 187	0,24
SCC Power PLC, 4 % (4 % liquidités ou 4 % PIK) jusqu'au 15/06/2024, 4 % Liquidités au 17/05/2032 (p)		637 470	108 051	0,05
TriMas Corp., 4,125 %, 15/04/2029		1 008 000	897 443	0,38
			7 602 452	3,23
Construction				
Mattamy Group Corp., 5,25 %, 15/12/2027		190 000	183 326	0,08
Mattamy Group Corp., 4,625 %, 1/03/2030		438 000	399 323	0,17
Weekley Homes LLC/Weekley Finance Corp., 4,875 %, 15/09/2028		539 000	502 357	0,21
			1 085 006	0,46
Biens de consommation				
Coty, Inc., 5,75 %, 15/09/2028	EUR	313 000	351 519	0,15
Energizer Gamma Acquisition B.V., 3,5 %, 30/06/2029		270 000	258 284	0,11
Energizer Holdings, Inc., 4,375 %, 31/03/2029	USD	566 000	512 349	0,22
HFC Prestige Products, Inc./HFC Prestige International US LLC, 6,625 %, 15/07/2030		650 000	662 071	0,28
International Design Group S.p.A., 10 %, 15/11/2028	EUR	792 000	887 874	0,38
Prestige Consumer Healthcare, Inc., 5,125 %, 15/01/2028	USD	492 000	481 579	0,20
Prestige Consumer Healthcare, Inc., 3,75 %, 1/04/2031		463 000	401 503	0,17
			3 555 179	1,51
Services de consommation				
Allied Universal Holdco LLC, 9,75 %, 15/07/2027		690 000	674 676	0,29
Allied Universal Holdco LLC, 6 %, 1/06/2029		200 000	166 058	0,07

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services de consommation, suite				
Arches Buyer, Inc., 6,125 %, 1/12/2028	USD	513 000	443 135	0,19
Cushman & Wakefield PLC, 6,75 %, 15/05/2028		470 000	463 570	0,20
GoDaddy, Inc., 3,5 %, 1/03/2029		916 000	829 346	0,35
GW B-CR Security Corp., 9,5 %, 1/11/2027		560 000	563 380	0,24
Match Group Holdings II LLC, 5 %, 15/12/2027		447 000	432 466	0,18
Match Group Holdings II LLC, 4,625 %, 1/06/2028		685 000	644 804	0,28
Match Group Holdings II LLC, 4,125 %, 1/08/2030		213 000	191 649	0,08
Match Group Holdings II LLC, 3,625 %, 1/10/2031		115 000	98 325	0,04
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,75 %, 15/01/2029		377 000	280 024	0,12
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,25 %, 15/04/2030		410 000	288 262	0,12
TriNet Group, Inc., 3,5 %, 1/03/2029		802 000	707 805	0,30
Verisure Holding AB, 3,25 %, 15/02/2027	EUR	385 000	399 718	0,17
Verisure Midholding AB, 5,25 %, 15/02/2029		890 000	916 569	0,39
WASH Multi-Family Acquisition, Inc., 5,75 %, 15/04/2026	USD	442 000	424 904	0,18
			7 524 691	3,20
Conteneurs				
ARD Finance S.A., 6,5 %, 30/06/2027 (p)		200 000	96 638	0,04
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 3,25 %, 1/09/2028		580 000	506 901	0,22
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 3 %, 1/09/2029	EUR	615 000	518 412	0,22
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 4 %, 1/09/2029	USD	587 000	475 747	0,20
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh MP Holdings USA, Inc., 5,25 %, 15/08/2027		651 000	486 611	0,21
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,875 %, 15/11/2029		2 014 000	1 774 958	0,75
Crown Americas LLC, 5,25 %, 1/04/2030		266 000	257 022	0,11
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. V, 4,25 %, 30/09/2026		872 000	840 451	0,36
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. VI, 4,75 %, 1/02/2026		55 000	53 855	0,02
Crown European Holdings S.A., 4,75 %, 15/03/2029	EUR	832 000	911 056	0,39
San Miguel Industrias PET S.A., 3,5 %, 2/08/2028	USD	1 050 000	908 250	0,39
Titan Holdings II B.V., 5,125 %, 15/07/2029	EUR	765 000	730 090	0,31
Trivium Packaging Finance B.V., 8,5 %, 15/08/2027	USD	371 000	362 021	0,15
			7 922 012	3,37
Électronique				
Entegris, Inc., 4,375 %, 15/04/2028		379 000	357 428	0,15
Entegris, Inc., 3,625 %, 1/05/2029		257 000	231 817	0,10
Sensata Technologies B.V., 5 %, 1/10/2025		731 000	727 692	0,31
Sensata Technologies B.V., 5,875 %, 1/09/2030		305 000	301 423	0,13
Sensata Technologies, Inc., 4,375 %, 15/02/2030		146 000	134 531	0,06
			1 752 891	0,75
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Bulgarian Energy Holdings, 2,45 %, 22/07/2028	EUR	1 099 000	1 035 903	0,44
Eustream A.S. (République slovaque), 1,625 %, 25/06/2027		433 000	394 242	0,17
Petroleos Mexicanos, 6,5 %, 13/03/2027	USD	655 000	614 219	0,26
Petroleos Mexicanos, 6,84 %, 23/01/2030		450 000	386 388	0,16
Petroleos Mexicanos, 10 %, 7/02/2033		676 000	668 528	0,28
Petroleos Mexicanos, 6,5 %, 2/06/2041		1 815 000	1 222 883	0,52
Petroleos Mexicanos, 7,69 %, 23/01/2050		860 000	601 232	0,26
			4 923 395	2,09
Énergie - Sociétés indépendantes				
Callon Petroleum Co., 8 %, 1/08/2028		409 000	423 017	0,18
Callon Petroleum Co., 7,5 %, 15/06/2030		135 000	142 215	0,06
Civitas Resources, Inc., 8,375 %, 1/07/2028		433 000	455 391	0,19
Civitas Resources, Inc., 8,625 %, 1/11/2030		135 000	143 986	0,06
Civitas Resources, Inc., 8,75 %, 1/07/2031		278 000	295 543	0,13
Comstock Resources, Inc., 6,75 %, 1/03/2029		775 000	711 643	0,30
CrownRock LP/CrownRock Finance, Inc., F, 5 %, 1/05/2029		530 000	523 412	0,22
Matador Resources Co., 6,875 %, 15/04/2028		513 000	525 322	0,22

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Énergie - Sociétés indépendantes, suite				
Moss Creek Resources Holdings, Inc., 7,5 %, 15/01/2026	USD	400 000	398 512	0,17
Permian Resources Operating LLC, 7,75 %, 15/02/2026		90 000	91 440	0,04
Permian Resources Operating LLC, 5,875 %, 1/07/2029		706 000	690 524	0,30
Permian Resources Operating LLC, 7 %, 15/01/2032		292 000	301 462	0,13
Sitio Royalties Operating Partnership, LP, 7,875 %, 1/11/2028		554 000	568 113	0,24
SM Energy Co., 6,5 %, 15/07/2028		359 000	359 000	0,15
			5 629 580	2,39
Énergie - Sociétés intégrées				
Citgo Petroleum Corp., 8,375 %, 15/01/2029		928 000	964 161	0,41
Divertissement				
Carnival Corp. PLC, 7,625 %, 1/03/2026		424 000	430 690	0,18
Carnival Corp. PLC, 5,75 %, 1/03/2027		799 000	787 177	0,34
Carnival Corp. PLC, 4 %, 1/08/2028		297 000	274 729	0,12
Carnival Corp. PLC, 6 %, 1/05/2029		368 000	356 436	0,15
Merlin Entertainments, 7,375 %, 15/02/2031		400 000	400 543	0,17
Motion Finco S.à r.l., 7,375 %, 15/06/2030	EUR	232 000	258 836	0,11
NCL Corp. Ltd., 5,875 %, 15/03/2026	USD	430 000	419 280	0,18
NCL Corp. Ltd., 7,75 %, 15/02/2029		280 000	282 715	0,12
Royal Caribbean Cruises Ltd., 5,375 %, 15/07/2027		387 000	380 812	0,16
Royal Caribbean Cruises Ltd., 5,5 %, 1/04/2028		580 000	572 619	0,24
SeaWorld Parks & Entertainment, 5,25 %, 15/08/2029		371 000	345 520	0,15
Viking Cruises Ltd. Co., 5,875 %, 15/09/2027		185 000	178 307	0,08
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd., 5,625 %, 15/02/2029		323 000	314 521	0,13
VOC Escrow Ltd., 5 %, 15/02/2028		269 000	256 868	0,11
			5 259 053	2,24
Établissements financiers				
Avation Capital S.A., 8,25 %, 31/10/2026 (p)		500 930	428 921	0,18
Castlelake Aviation Finance Designated Activity Co., 5 %, 15/04/2027		112 000	106 315	0,04
Citycon Treasury B.V., 1,625 %, 12/03/2028	EUR	550 000	488 002	0,21
Credit Acceptance Corp., 6,625 %, 15/03/2026	USD	62 000	61 987	0,03
Credit Acceptance Corp., 9,25 %, 15/12/2028		469 000	492 453	0,21
Encore Capital Group, Inc., 5,375 %, 15/02/2026	GBP	415 000	507 023	0,22
Encore Capital Group, Inc., 4,25 %, 1/06/2028		456 000	499 874	0,21
Freedom Mortgage Corp., 7,625 %, 1/05/2026	USD	371 000	369 489	0,16
Freedom Mortgage Holdings LLC, 9,25 %, 1/02/2029		117 000	118 474	0,05
FTAI Aviation Ltd., 5,5 %, 1/05/2028		271 000	262 594	0,11
FTAI Aviation Ltd., 7,875 %, 1/12/2030		313 000	330 148	0,14
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		1 109 379	1 069 164	0,45
Globalworth Ltd., REIT, 2,95 %, 29/07/2026	EUR	585 000	540 628	0,23
Heimstaden Bostad Treasury B.V., 1,375 %, 24/07/2028		530 000	441 235	0,19
Howard Hughes Corp., 4,125 %, 1/02/2029	USD	678 000	611 453	0,26
Jefferson Capital Holdings LLC, 9,5 %, 15/02/2029		415 000	417 977	0,18
Macquarie AirFinance Holdings Ltd., 8,375 %, 1/05/2028		579 000	608 211	0,26
Macquarie AirFinance Holdings Ltd., 8,125 %, 30/03/2029		103 000	106 870	0,05
Nationstar Mortgage Holdings, Inc., 6 %, 15/01/2027		803 000	787 359	0,33
OneMain Finance Corp., 6,875 %, 15/03/2025		461 000	462 729	0,20
OneMain Finance Corp., 7,125 %, 15/03/2026		644 000	652 780	0,28
OneMain Finance Corp., 5,375 %, 15/11/2029		320 000	296 082	0,13
PRA Group, Inc., 8,375 %, 1/02/2028		186 000	177 172	0,08
Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc., 3,625 %, 1/03/2029		376 000	334 210	0,14
Rocket Mortgage Co-Issuer, Inc., 3,875 %, 1/03/2031		139 000	121 460	0,05
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,375 %, 4/09/2026	EUR	427 000	353 897	0,15
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,875 % jusqu'au 30/01/2027, FLR jusqu'au 30/01/2171		995 000	193 553	0,08

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Établissements financiers, suite				
SLM Corp., 3,125 %, 2/11/2026	USD	287 000	268 724	0,11
			11 108 784	4,73
Alimentation et boissons				
Aragvi Finance International DAC, 8,45 %, 29/04/2026		508 000	362 712	0,15
B&G Foods, Inc., 5,25 %, 15/09/2027		232 000	209 253	0,09
B&G Foods, Inc., 8 %, 15/09/2028		271 000	282 488	0,12
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029		976 000	911 711	0,39
Chobani LLC/Chobani Finance Corp., 7,625 %, 1/07/2029		47 000	47 586	0,02
Fiesta Purchaser, Inc., 7,875 %, 1/03/2031		375 000	379 376	0,16
Minerva Luxembourg S.A., 4,375 %, 18/03/2031		543 000	447 131	0,19
Performance Food Group Co., 5,5 %, 15/10/2027		575 000	560 797	0,24
Post Holdings, Inc., 5,625 %, 15/01/2028		427 000	420 212	0,18
Post Holdings, Inc., 4,625 %, 15/04/2030		783 000	720 085	0,31
Primo Water Holding, Inc., 4,375 %, 30/04/2029		825 000	751 082	0,32
TreeHouse Foods, Inc., 4 %, 1/09/2028		512 000	456 704	0,19
U.S. Foods Holding Corp., 4,75 %, 15/02/2029		645 000	611 955	0,26
United Natural Foods, Inc., 6,75 %, 15/10/2028		300 000	252 000	0,11
			6 413 092	2,73
Jeux et hôtellerie				
Allwyn International A.S., 3,875 %, 15/02/2027	EUR	1 240 000	1 293 889	0,55
Caesars Entertainment, Inc., 4,625 %, 15/10/2029	USD	249 000	227 615	0,10
Caesars Entertainment, Inc., 7 %, 15/02/2030		481 000	494 299	0,21
Caesars Entertainment, Inc., 6,5 %, 15/02/2032		140 000	141 549	0,06
Caesars Resort Collection LLC/CRC Finco, Inc., 8,125 %, 1/07/2027		520 000	533 648	0,23
CCM Merger, Inc., 6,375 %, 1/05/2026		478 000	472 064	0,20
CDI Escrow Issuer, Inc., 5,75 %, 1/04/2030		652 000	630 764	0,27
NH Hotel Group S.A., 4 %, 2/07/2026	EUR	860 000	918 156	0,39
Penn National Gaming, Inc., 4,125 %, 1/07/2029	USD	602 000	514 701	0,22
Playtech PLC, 5,875 %, 28/06/2028	EUR	524 000	563 455	0,24
Wyndham Hotels & Resorts, Inc., 4,375 %, 15/08/2028	USD	600 000	560 192	0,24
Wynn Macau Ltd., 5,5 %, 1/10/2027		384 000	361 038	0,15
Wynn Macau Ltd., 5,625 %, 26/08/2028		420 000	390 895	0,16
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp., 5,125 %, 1/10/2029		607 000	573 437	0,24
			7 675 702	3,26
Industrie				
Albion Financing 1 S.à r.l., 5,25 %, 15/10/2026	EUR	272 000	290 276	0,12
Albion Financing 1 S.à r.l., 6,125 %, 15/10/2026	USD	310 000	304 522	0,13
Albion Financing 2 S.à r.l., 8,75 %, 15/04/2027		220 000	219 768	0,09
APi Escrow Corp., 4,75 %, 15/10/2029		775 000	725 648	0,31
Williams Scotsman International, Inc., 4,625 %, 15/08/2028		710 000	672 068	0,29
			2 212 282	0,94
Assurances IARD				
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc., 8,25 %, 1/02/2029		280 000	280 718	0,12
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc., 4,25 %, 15/02/2029		149 000	133 607	0,06
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc., 6 %, 1/08/2029		279 000	255 937	0,11
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6,75 %, 15/10/2027		395 000	385 646	0,16
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 5,875 %, 1/11/2029		672 000	636 404	0,27
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 7 %, 15/01/2031		367 000	370 890	0,16
AmWINS Group Benefits, Inc., 4,875 %, 30/06/2029		558 000	520 808	0,22
AssuredPartners, Inc., 5,625 %, 15/01/2029		545 000	514 707	0,22
GTCR (AP) Finance, Inc., 8 %, 15/05/2027		245 000	245 463	0,10
Hub International Ltd., 5,625 %, 1/12/2029		465 000	438 778	0,19
Hub International Ltd., 7,25 %, 15/06/2030		373 000	383 693	0,16
Hub International Ltd., 7,375 %, 31/01/2032		341 000	349 217	0,15
			4 515 868	1,92

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Machines et outils				
Husky Injection Molding Systems Ltd., 9 %, 15/02/2029	USD	47 000	47 000	0,02
Ritchie Bros Holdings, Inc., 7,75 %, 15/03/2031		755 000	795 634	0,34
Sarens Finance Co. N.V., 5,75 %, 21/02/2027	EUR	679 000	682 430	0,29
Terex Corp., 5 %, 15/05/2029	USD	532 000	502 741	0,21
			2 027 805	0,86
Grandes banques				
Toronto-Dominion Bank, 8,125 % jusqu'au 31/10/2027, FLR jusqu'au 31/10/2082		645 000	669 916	0,28
UniCredit S.p.A., 3,875 % jusqu'au 3/06/2027, FLR jusqu'au 3/06/2070	EUR	755 000	702 524	0,30
			1 372 440	0,58
Technologies et services médicaux et de santé				
180 Medical, Inc., 3,875 %, 15/10/2029	USD	700 000	625 688	0,27
Avantor Funding, Inc., 4,625 %, 15/07/2028		791 000	753 064	0,32
Bausch & Lomb Escrow Corp., 8,375 %, 1/10/2028		485 000	503 222	0,21
Charles River Laboratories International, Inc., 3,75 %, 15/03/2029		954 000	867 636	0,37
CHS/Community Health Systems, Inc., 8 %, 15/12/2027		332 000	326 947	0,14
CHS/Community Health Systems, Inc., 6,125 %, 1/04/2030		627 000	408 097	0,17
CHS/Community Health Systems, Inc., 5,25 %, 15/05/2030		694 000	574 579	0,24
Encompass Health Corp., 5,75 %, 15/09/2025		206 000	204 688	0,09
Encompass Health Corp., 4,75 %, 1/02/2030		564 000	528 956	0,23
Encompass Health Corp., 4,625 %, 1/04/2031		85 000	78 092	0,03
Ephios Subco 3 S.à r.l., 7,875 %, 31/01/2031	EUR	537 000	611 986	0,26
IQVIA, Inc., 5 %, 15/05/2027	USD	695 000	679 248	0,29
IQVIA, Inc., 6,5 %, 15/05/2030		400 000	408 028	0,17
Laboratoire Eimer Selas, 5 %, 1/02/2029	EUR	706 000	652 709	0,28
Legacy LifePoint Health LLC, 4,375 %, 15/02/2027	USD	463 000	431 201	0,18
Star Parent, Inc., 9 %, 1/10/2030		412 000	433 219	0,18
Tenet Healthcare Corp., 6,125 %, 1/10/2028		376 000	374 616	0,16
Tenet Healthcare Corp., 4,375 %, 15/01/2030		324 000	299 803	0,13
Tenet Healthcare Corp., 6,125 %, 15/06/2030		556 000	555 793	0,24
Tenet Healthcare Corp., 6,75 %, 15/05/2031		225 000	230 139	0,10
U.S. Acute Care Solutions LLC, 6,375 %, 1/03/2026		445 000	388 846	0,17
			9 936 557	4,23
Équipements médicaux				
Embecta Corp., 5 %, 15/02/2030		537 000	439 417	0,19
Garden SpinCo Corp., 8,625 %, 20/07/2030		485 000	518 950	0,22
Medline Borrower LP, 5,25 %, 1/10/2029		697 000	649 889	0,28
Teleflex, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		271 000	262 905	0,11
			1 871 161	0,80
Métaux et exploitation minière				
Baffinland Iron Mines Corp./Baffinland Iron Mines LP, 8,75 %, 15/07/2026		709 000	648 740	0,28
FMG Resources Ltd., 4,375 %, 1/04/2031		1 327 000	1 194 291	0,51
GrafTech Finance, Inc., 4,625 %, 15/12/2028		646 000	427 735	0,18
GrafTech Finance, Inc., 9,875 %, 15/12/2028		157 000	117 328	0,05
Kaiser Aluminum Corp., 4,625 %, 1/03/2028		644 000	593 442	0,25
Kaiser Aluminum Corp., 4,5 %, 1/06/2031		338 000	288 581	0,12
Novelis Corp., 3,25 %, 15/11/2026		409 000	382 956	0,16
Novelis Corp., 4,75 %, 30/01/2030		541 000	501 775	0,22
Novelis Corp., 3,875 %, 15/08/2031		296 000	256 732	0,11
Novelis Sheet Ingot GmbH, 3,375 %, 15/04/2029	EUR	540 000	544 021	0,23
Petra Diamonds US\$ Treasury PLC, 9,75 %, 8/03/2026	USD	245 506	198 860	0,09
Petra Diamonds US\$ Treasury PLC, 9,75 %, 8/03/2026		734 065	594 592	0,25
Taseko Mines Ltd., 7 %, 15/02/2026		430 000	422 475	0,18
			6 171 528	2,63
Secteur intermédiaire				
DT Midstream, Inc., 4,125 %, 15/06/2029		551 000	506 230	0,22

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Secteur intermédiaire, suite				
DT Midstream, Inc., 4,375 %, 15/06/2031	USD	721 000	645 851	0,27
EQM Midstream Partners LP, 5,5 %, 15/07/2028		1 028 000	1 018 639	0,43
Kinetik Holdings, Inc., 5,875 %, 15/06/2030		641 000	629 626	0,27
NuStar Logistics, LP, 6,375 %, 1/10/2030		455 000	457 275	0,19
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030		855 000	703 850	0,30
Tallgrass Energy Partners LP, 5,5 %, 15/01/2028		766 000	737 405	0,31
Tallgrass Energy Partners LP, 7,375 %, 15/02/2029		276 000	275 314	0,12
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3,875 %, 15/08/2029		636 000	568 433	0,24
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 6,25 %, 15/01/2030		318 000	318 252	0,14
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15/08/2031		385 000	340 464	0,15
Venture Global LNG, Inc., 8,125 %, 1/06/2028		470 000	475 024	0,20
Venture Global LNG, Inc., 9,5 %, 1/02/2029		530 000	562 881	0,24
Venture Global LNG, Inc., 8,375 %, 1/06/2031		541 000	546 321	0,23
			7 785 565	3,31
Réseaux et télécommunications				
Iliad Holding S.A.S., 6,5 %, 15/10/2026		200 000	196 052	0,08
Iliad Holding S.A.S., 5,625 %, 15/10/2028	EUR	420 000	455 056	0,20
Iliad Holding S.A.S., 7 %, 15/10/2028	USD	738 000	732 120	0,31
Iliad S.A., 5,625 %, 15/02/2030	EUR	300 000	335 942	0,14
Kaixo Bondco Telecom S.A., 5,125 %, 30/09/2029		1 065 000	1 109 360	0,47
			2 828 530	1,20
Services pétroliers				
Nabors Industries Ltd., 7,25 %, 15/01/2026	USD	351 000	342 250	0,14
Nabors Industries Ltd., 9,125 %, 31/01/2030		222 000	225 896	0,10
			568 146	0,24
Pétrole				
FS Luxembourg S.à r.l., 8,875 %, 12/02/2031		476 000	469 764	0,20
MC Brazil Downstream Trading S.à r.l., 7,25 %, 30/06/2031		816 695	627 893	0,27
Parkland Corp., 4,625 %, 1/05/2030		989 000	911 185	0,39
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp., 6 %, 15/02/2028		525 000	513 119	0,22
Puma International Financing S.A., 5 %, 24/01/2026		430 000	407 279	0,17
			2 929 240	1,25
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
Banco GNB Sudameris S.A., 7,5 % jusqu'au 16/04/2026, FLR jusqu'au 16/04/2031		845 000	717 828	0,31
BBVA Bancomer S.A. (Texas), 8,125 %, 8/01/2039		1 046 000	1 064 174	0,45
Intesa Sanpaolo S.p.A., 4,125 % jusqu'au 27/02/2030, FLR jusqu'au 27/02/2070	EUR	755 000	670 003	0,28
			2 452 005	1,04
Ordinateurs personnels et périphériques				
NCR Voyix Corp., 5 %, 1/10/2028	USD	644 000	607 143	0,26
NCR Voyix Corp., 5,125 %, 15/04/2029		306 000	286 302	0,12
			893 445	0,38
Produits pharmaceutiques				
1375209 BC Ltd., 9 %, 30/01/2028		128 000	124 160	0,05
1375209 BC Ltd., 9 %, 30/01/2028		186 000	180 420	0,08
Bausch Health Co., Inc., 11 %, 30/09/2028		331 000	225 179	0,10
Bausch Health Co., Inc., 14 %, 15/10/2030		66 000	36 896	0,02
Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, 15/01/2028	EUR	543 000	567 050	0,24
Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 7,5 %, 15/05/2030		405 000	460 233	0,20
Grifols S.A., 3,2 %, 1/05/2025		823 000	847 000	0,36
Organon & Co., 2,875 %, 30/04/2028		265 000	266 253	0,11
Organon Finance 1 LLC, 4,125 %, 30/04/2028	USD	311 000	284 549	0,12
Organon Finance 1 LLC, 5,125 %, 30/04/2031		524 000	450 183	0,19
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III B.V., 4,75 %, 9/05/2027		1 075 000	1 038 719	0,44
			4 480 642	1,91

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Lutte contre la pollution				
GFL Environmental, Inc., 4,25 %, 1/06/2025	USD	170 000	167 017	0,07
GFL Environmental, Inc., 4 %, 1/08/2028		528 000	484 315	0,21
GFL Environmental, Inc., 4,75 %, 15/06/2029		200 000	187 749	0,08
GFL Environmental, Inc., 4,375 %, 15/08/2029		255 000	233 867	0,10
GFL Environmental, Inc., 6,75 %, 15/01/2031		103 000	105 346	0,04
Stericycle, Inc., 3,875 %, 15/01/2029		677 000	615 413	0,26
			1 793 707	0,76
Métaux et minéraux précieux				
Coeur Mining, Inc., 5,125 %, 15/02/2029		329 000	299 472	0,13
Eldorado Gold Corp., 6,25 %, 1/09/2029		742 000	707 671	0,30
IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15/10/2028		589 000	518 320	0,22
			1 525 463	0,65
Imprimerie et édition				
Cimpress PLC, 7 %, 15/06/2026		516 000	508 260	0,22
Immobilier - Autres				
RHP Hotel Properties, LP/RHP Finance Corp., 7,25 %, 15/07/2028		785 000	809 182	0,34
XHR LP, REIT, 4,875 %, 1/06/2029		446 000	411 350	0,18
			1 220 532	0,52
Restaurants				
Fertitta Entertainment LLC, 6,75 %, 15/01/2030		557 000	500 769	0,21
Midco GB S.A.S., 7,75 %, 1/11/2027 (p)	EUR	535 000	578 157	0,25
			1 078 926	0,46
Distribution				
Asbury Automotive Group, Inc., 4,625 %, 15/11/2029	USD	433 000	398 917	0,17
B&M EuropeanValue Retail S.A., 8,125 %, 15/11/2030	GBP	425 000	571 592	0,24
Grupo Axo S.A.P.I. de C.V., 5,75 %, 8/06/2026	USD	1 113 000	1 039 974	0,44
Lithia Motors, Inc., 3,875 %, 1/06/2029		460 000	412 850	0,18
Macy's Retail Holdings LLC, 5,875 %, 1/04/2029		548 000	531 560	0,23
Mobilux Finance S.A.S., 4,25 %, 15/07/2028	EUR	700 000	669 494	0,28
NMG Holding Co. Inc./Neiman Marcus Group LLC, 7,125 %, 1/04/2026	USD	396 000	386 106	0,16
Penske Automotive Group Co., 3,75 %, 15/06/2029		623 000	555 233	0,24
Victoria's Secret & Co., 4,625 %, 15/07/2029		479 000	404 984	0,17
			4 970 710	2,11
Produits chimiques spéciaux				
Braskem Netherlands B.V., 4,5 %, 10/01/2028		785 000	681 220	0,29
CTEC II GmbH, 5,25 %, 15/02/2030	EUR	701 000	678 444	0,29
			1 359 664	0,58
Magasins spécialisés				
Dufry One B.V., 3,375 %, 15/04/2028		1 210 000	1 250 438	0,53
Global Auto Holdings Ltd./Aag FH UK Ltd., 8,375 %, 15/01/2029	USD	465 000	438 439	0,19
Michael Cos., Inc., 5,25 %, 1/05/2028		275 000	216 004	0,09
Michael Cos., Inc., 7,875 %, 1/05/2029		382 000	244 325	0,11
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp., 7,75 %, 15/02/2029		690 000	667 011	0,28
			2 816 217	1,20
Hypermarchés				
Eroski Sociedad Cooperativa, 10,625 %, 30/04/2029	EUR	1 315 000	1 508 500	0,64
KeHE Distributors LLC/KeHE Finance Corp., 9 %, 15/02/2029	USD	375 000	377 109	0,16
Ocado Group PLC, 3,875 %, 8/10/2026	GBP	863 000	947 400	0,40
Picard Bondco S.A., 5,375 %, 1/07/2027	EUR	1 046 000	1 073 779	0,46
			3 906 788	1,66
Télécommunications mobiles				
Altice France Holding S.A., 4 %, 15/02/2028		270 000	124 010	0,05
Altice France S.A., 3,375 %, 15/01/2028		157 000	130 955	0,06
Altice France S.A., 5,5 %, 15/01/2028	USD	235 000	183 479	0,08
Altice France S.A., 6 %, 15/02/2028		283 000	126 337	0,05

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Télécommunications mobiles, suite				
Altice France S.A., 5,125 %, 15/07/2029	USD	200 000	146 219	0,06
Cellnex Finance Co. S.A., 1,5 %, 8/06/2028	EUR	1 000 000	995 465	0,42
Cellnex Finance Co. S.A., 2 %, 15/02/2033		900 000	835 999	0,36
Millicom International Cellular S.A., 5,125 %, 15/01/2028	USD	887 400	831 210	0,35
PLT VII Finance S.à r.l., 4,625 %, 5/01/2026	EUR	758 000	814 051	0,35
PPF Telecom Group B.V., 2,125 %, 31/01/2025		330 000	349 142	0,15
PPF Telecom Group B.V., 3,25 %, 29/09/2027		867 000	908 498	0,39
SBA Communications Corp., 3,875 %, 15/02/2027	USD	455 000	434 216	0,18
SBA Communications Corp., 3,125 %, 1/02/2029		840 000	748 636	0,32
Vmed O2 UK Financing I PLC, 4 %, 31/01/2029	GBP	331 000	372 302	0,16
Vodafone Group PLC, 3 %, 27/08/2080	EUR	895 000	865 668	0,37
WP/AP Telecom Holdings III B.V., 5,5 %, 15/01/2030		631 000	621 401	0,26
			8 487 588	3,61
Transports - Services				
Acu Petroleo Luxembourg S.à r.l., 7,5 %, 13/01/2032	USD	528 487	506 390	0,21
Arena Luxembourg Finance S.à r.l., 1,875 %, 1/02/2028	EUR	1 420 000	1 357 502	0,58
Cliffon Ltd., 6,25 %, 25/10/2025	USD	825 000	818 813	0,35
Hidrovias International Finance S.à r.l., 4,95 %, 8/02/2031		560 000	459 482	0,20
Q-Park Holding I B.V., 2 %, 1/03/2027	EUR	683 000	690 957	0,29
			3 833 144	1,63
Obligations du Trésor américain				
Bons du Trésor américain, 3 %, 30/06/2024	USD	774 000	767 167	0,33
Services publics - Énergie électrique				
Adani Green Energy (UP) Ltd./Prayatna Developers Private Ltd., 6,25 %, 10/12/2024		942 000	933 569	0,40
AES Gener S.A., 7,125 %, 26/03/2079		655 000	628 276	0,27
Azure Power Energy Ltd., 3,575 %, 19/08/2026		530 807	486 497	0,21
Azure Power Solar Energy Private Ltd., 5,65 %, 24/12/2024		470 000	456 887	0,19
Calpine Corp., 4,5 %, 15/02/2028		664 000	631 442	0,27
Calpine Corp., 5,125 %, 15/03/2028		498 000	475 200	0,20
Clearway Energy Operating LLC, 4,75 %, 15/03/2028		419 000	398 931	0,17
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/02/2031		1 075 000	931 844	0,40
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/01/2032		145 000	123 155	0,05
ContourGlobal Power Holdings S.A., 2,75 %, 1/01/2026	EUR	805 000	831 903	0,35
ContourGlobal Power Holdings S.A., 3,125 %, 1/01/2028		242 000	236 001	0,10
Electricidad Firme de Mexico Holdings S.A. de C.V., 4,9 %, 20/11/2026	USD	861 000	794 192	0,34
Greenko Dutch B.V. (République de l'Inde), 3,85 %, 29/03/2026		800 125	752 117	0,32
Investment Energy Resources Ltd., 6,25 %, 26/04/2029		838 000	796 913	0,34
Mercury Chile Holdco LLC, 6,5 %, 24/01/2027		806 000	749 531	0,32
Mong Duong Finance Holdings B.V., 5,125 %, 7/05/2029		747 977	701 072	0,30
NextEra Energy, Inc., 4,25 %, 15/07/2024		94 000	93 008	0,04
NextEra Energy, Inc., 4,25 %, 15/09/2024		95 000	92 863	0,04
NextEra Energy, Inc., 4,5 %, 15/09/2027		521 000	489 238	0,21
NextEra Energy, Inc., 7,25 %, 15/01/2029		554 000	570 622	0,24
ReNew Power, 4,5 %, 14/07/2028		891 000	813 850	0,34
TerraForm Global Operating LLC, 6,125 %, 1/03/2026		450 000	444 104	0,19
TerraForm Global Operating LLC, 6,125 %, 1/03/2026		1 029 000	1 015 517	0,43
TerraForm Power Operating LLC, 5 %, 31/01/2028		802 000	772 984	0,33
TerraForm Power Operating LLC, 4,75 %, 15/01/2030		254 000	234 521	0,10
			14 454 237	6,15
Services publics - Gaz				
EP Infrastructure A.S., 2,045 %, 9/10/2028	EUR	250 000	229 927	0,10
EP Infrastructure A.S., 1,816 %, 2/03/2031		1 083 000	921 408	0,39
			1 151 335	0,49

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global High Yield Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services publics - Autres				
Aegea Finance S.à r.l., 6,75 %, 20/05/2029	USD	1 411 000	1 369 322	0,58
Total des obligations (coût identifié, 236 484 644 \$)			223 279 271	94,98
ACTIONS ORDINAIRES				
Télévision par câble				
Intelsat Emergence S.A.		6 933	181 991	0,08
Services pétroliers				
LTRI Holdings LP (b)		1 240	627 651	0,27
Total des actions ordinaires (coût identifié, 1 056 612 \$)			809 642	0,35
OBLIGATIONS CONVERTIBLES				
Services publics - Énergie électrique				
Pacific Gas and Electric Corp., 4,25 %, 1/12/2027 (coût identifié, 214 000 \$)	USD	214 000	217 745	0,09
WARRANTS				
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
Avation Capital S.A. (1 action contre 1 warrant, Expiration 31/10/26) (coût identifié, 0 \$)	GBP 1,14	N/A	8 313	0,00
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 798 000 \$)	USD	798 000	797 885	0,34
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 238 553 256 \$)			225 106 123	95,76
Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats	
Russell 2000 Index – Décembre 2024 @ 1 500 \$ (primes versées, 171 816 \$)		4 673 620	24	66 480
Total des investissements (coût identifié, 238 725 072 \$) (k)				225 172 603
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF				9 896 946
ACTIF NET				235 069 549

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Global Intrinsic Value Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES				
Compagnies aériennes				
Ryanair Holdings PLC, ADR		2 739	365 930	0,51
Boissons alcoolisées				
Diageo PLC		16 954	609 781	0,86
Pernod Ricard S.A.		2 865	471 529	0,66
			1 081 310	1,52
Industrie de la confection				
Adidas AG		2 188	416 448	0,58
Compagnie Financiere Richemont S.A.		2 860	427 534	0,60
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE		408	339 334	0,48
			1 183 316	1,66
Industrie automobile				
Knorr-Bremse AG		4 491	277 847	0,39
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Charles Schwab Corp.		17 952	1 129 540	1,59

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Intrinsic Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs, suite			
CME Group, Inc.	5 103	1 050 402	1,47
Deutsche Boerse AG	5 072	1 012 672	1,42
		3 192 614	4,48
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	2 389	869 309	1,22
Experian PLC	14 917	621 903	0,87
Ferguson PLC	3 227	606 224	0,85
Intertek Group PLC	4 339	246 173	0,35
SGS S.A.	4 720	436 682	0,61
Verisk Analytics, Inc., "A"	1 770	427 508	0,60
		3 207 799	4,50
Produits chimiques			
Givaudan S.A.	111	461 793	0,65
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	803	496 077	0,70
ANSYS, Inc.	1 385	454 045	0,64
Autodesk, Inc.	1 209	306 856	0,43
Cadence Design Systems, Inc.	6 596	1 902 682	2,67
Dassault Systemes SE	8 320	433 702	0,61
Kinaxis, Inc.	3 990	485 881	0,68
LiveRamp Holdings, Inc.	3 698	145 997	0,20
Microsoft Corp.	5 783	2 299 205	3,22
NICE Systems Ltd., ADR	1 395	290 300	0,41
Salesforce, Inc.	3 148	884 871	1,24
Synopsys, Inc.	3 152	1 681 119	2,36
		9 380 735	13,16
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	7 200	503 303	0,71
Cap Gemini S.A.	4 475	1 002 047	1,40
Samsung Electronics Co. Ltd.	12 477	676 562	0,95
Workday, Inc.	1 794	522 179	0,73
		2 704 091	3,79
Construction			
Compagnie de Saint-Gobain S.A.	7 762	549 661	0,77
CRH PLC	9 163	657 537	0,92
Martin Marietta Materials, Inc.	1 757	893 294	1,25
Otis Worldwide Corp.	7 211	637 741	0,90
Sherwin-Williams Co.	1 421	432 524	0,61
Vulcan Materials Co.	4 325	977 493	1,37
Watsco, Inc.	1 679	656 456	0,92
		4 804 706	6,74
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	16 769	1 411 950	1,98
Haleon PLC	193 485	788 330	1,11
Kenvue, Inc.	29 269	607 624	0,85
L'Oréal S.A.	632	303 063	0,42
Lion Corp.	18 800	168 099	0,24
ROHTO Pharmaceutical Co. Ltd.	29 300	600 092	0,84
Svenska Cellulosa Aktiebolaget	23 491	319 696	0,45
		4 198 854	5,89
Équipements électriques			
Johnson Controls International PLC	8 323	438 539	0,62
Legrand S.A.	10 047	976 966	1,37
Mitsubishi Electric Corp.	41 800	615 573	0,86
Rockwell Automation, Inc.	2 235	566 081	0,79

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Intrinsic Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Équipements électriques, suite			
Schneider Electric SE	6 607	1 302 158	1,83
		3 899 317	5,47
Électronique			
Analog Devices, Inc.	5 601	1 077 408	1,51
Applied Materials, Inc.	2 265	372 139	0,52
KLA Corp.	892	529 884	0,74
Lam Research Corp.	618	509 955	0,72
Micron Technology, Inc.	1 421	121 851	0,17
Sensirion Holding AG	3 151	261 986	0,37
Silicon Laboratories, Inc.	2 295	283 111	0,40
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	9 811	1 108 251	1,55
		4 264 585	5,98
Énergie - Sociétés indépendantes			
Woodside Energy Group Ltd.	46 171	967 708	1,36
Énergie - Sociétés intégrées			
Aker BP ASA	15 510	411 325	0,58
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	26 790	439 356	0,62
TotalEnergies SE	22 593	1 471 438	2,06
		2 322 119	3,26
Ingénierie - Construction			
Taisei Corp.	8 100	295 319	0,42
Alimentation et boissons			
Chocoladefabriken Lindt & Sprungli AG	45	572 668	0,80
Ezaki Glico Co. Ltd.	7 300	214 318	0,30
Novozymes A/S	6 883	352 670	0,50
Toyo Suisan Kaisha Ltd.	8 600	447 375	0,63
		1 587 031	2,23
Assurances			
Aon PLC	3 831	1 143 285	1,60
Marsh & McLennan Cos., Inc.	4 781	926 749	1,30
		2 070 034	2,90
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	5 313	744 351	1,04
M3, Inc.	21 600	341 228	0,48
		1 085 579	1,52
Machines et outils			
Epiroc AB	21 054	370 553	0,52
Graco, Inc.	3 276	279 443	0,39
IDEX Corp.	1 814	383 661	0,54
Ingersoll Rand, Inc.	6 407	511 663	0,72
MSA Safety Inc.	1 548	255 467	0,36
RBC Bearings, Inc.	1 547	415 431	0,58
Regal Rexnord Corp.	2 037	271 858	0,38
Schindler Holding AG	2 623	656 548	0,92
SMC Corp.	900	500 851	0,70
Spirax-Sarco Engineering PLC	2 714	341 594	0,48
Watts Water Technologies, "A"	5 740	1 136 577	1,60
		5 123 646	7,19
Grandes banques			
Bank of Ireland Group PLC	73 282	672 432	0,94
NatWest Group PLC	285 341	809 172	1,14
Resona Holdings, Inc.	172 000	954 480	1,34
		2 436 084	3,42
Équipements médicaux			
Agilent Technologies, Inc.	7 722	1 004 632	1,41

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Intrinsic Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)	
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Équipements médicaux, suite				
Bio-Techne Corp.	2 754	193 661	0,27	
Bruker BioSciences Corp.	12 774	913 469	1,28	
Danaher Corp.	1 985	476 221	0,67	
Envista Holdings Corp.	17 026	400 111	0,56	
EssilorLuxottica	2 095	411 892	0,58	
Maravai Lifesciences Holdings, Inc., "A"	10 141	58 818	0,08	
Nakanishi, Inc.	23 000	377 791	0,53	
Shimadzu Corp.	16 400	453 770	0,64	
		4 290 365	6,02	
Métaux et exploitation minière				
Glencore PLC	89 841	478 705	0,67	
Gaz naturel - Distribution				
Gaztransport & Technigaz S.A.	2 081	292 587	0,41	
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
AIB Group PLC	230 820	1 011 999	1,42	
CaixaBank S.A.	161 659	690 783	0,97	
Chiba Bank Ltd.	51 300	381 555	0,53	
Moody's Corp.	2 415	946 776	1,33	
S&P Global, Inc.	899	403 067	0,57	
		3 434 180	4,82	
Produits pharmaceutiques				
Bayer AG	6 040	188 022	0,26	
Métaux et minéraux précieux				
Agnico Eagle Mines Ltd.	5 264	258 727	0,37	
Franco-Nevada Corp.	8 493	918 883	1,29	
Wheaton Precious Metals Corp.	11 897	557 612	0,78	
		1 735 222	2,44	
Imprimerie et édition				
Wolters Kluwer N.V.	3 679	542 710	0,76	
Immobilier				
CBRE Group, Inc., "A"	4 131	356 547	0,50	
LEG Immobilien SE	1 263	105 471	0,15	
TAG Immobilien AG	4 624	65 256	0,09	
Vonovia SE, REIT	2 716	85 030	0,12	
		612 304	0,86	
Produits chimiques spéciaux				
Corteva, Inc.	7 268	330 549	0,46	
Sika AG	1 755	484 416	0,68	
Symrise AG	3 293	341 426	0,48	
		1 156 391	1,62	
Magasins spécialisés				
Amazon.com, Inc.	5 198	806 730	1,13	
Costco Wholesale Corp.	1 865	1 295 951	1,82	
Zalando SE	8 289	167 334	0,24	
		2 270 015	3,19	
Total des actions ordinaires (coût identifié, 66 077 337 \$)		69 910 918	98,09	
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 107 000 \$)	USD	107 000	106 985	0,15
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 66 184 337 \$) (k)		70 017 903	98,24	
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		1 257 525	1,76	
ACTIF NET		71 275 428	100,00	

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Listed Infrastructure Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Compagnies aériennes			
Aena SME S.A.	618	109 382	4,77
Auckland International Airport Ltd.	7 782	40 123	1,75
Enav S.p.A.	9 709	35 990	1,57
Grupo Aeroportuario del Sureste, "B"	1 460	42 560	1,86
		228 055	9,95
Énergie - Renouvelables			
Orsted A/S	557	30 709	1,34
Ingénierie - Construction			
VINCI S.A.	492	62 252	2,72
Gaz naturel - Distribution			
Atmos Energy Corp.	437	49 792	2,17
Italgas S.p.A.	4 675	26 645	1,16
		76 437	3,33
Gaz naturel - Gazoducs			
APA Group	6 863	38 129	1,67
TC Energy Corp.	2 279	89 909	3,92
		128 038	5,59
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian National Railway Co.	548	67 980	2,97
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	705	56 732	2,47
CSX Corp.	2 931	104 637	4,57
Getlink S.E.	1 364	23 488	1,02
Union Pacific Corp.	346	84 400	3,68
		337 237	14,71
Produits chimiques spéciaux			
Air Liquide S.A.	155	29 053	1,27
Linde PLC	56	22 670	0,99
		51 723	2,26
Télécommunications mobiles			
Cellnex Telecom S.A.	2 406	92 645	4,04
SBA Communications Corp., REIT	512	114 616	5,00
Wireless Infrastructure Italian S.p.A.	1 757	21 352	0,93
		228 613	9,97
Services publics - Énergie électrique			
Alliant Energy Corp.	1 237	60 192	2,63
CLP Holdings Ltd.	4 500	35 671	1,56
Dominion Energy, Inc.	1 718	78 547	3,43
DTE Energy Co.	374	39 427	1,72
Edison International	766	51 690	2,26
Enel S.p.A.	3 284	22 399	0,98
Energias de Portugal S.A.	9 360	41 759	1,82
Energisa S.A., IEU	2 700	27 581	1,20
Equatorial Energia S.A.	4 300	30 750	1,34
Evergy, Inc.	1 101	55 898	2,44
Iberdrola S.A.	3 144	37 880	1,65
National Grid PLC	6 061	80 679	3,52
NextEra Energy, Inc.	908	53 236	2,32
PG&E Corp.	3 971	66 991	2,92
PPL Corp.	3 264	85 517	3,73
RWE AG	1 630	60 474	2,64
Sempra Energy	1 602	114 639	5,00
Xcel Energy, Inc.	1 306	78 190	3,41
		1 021 520	44,57
Services publics - Eau			
American Water Works Co., Inc.	262	32 493	1,42

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Listed Infrastructure Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Services publics - Eau, suite			
Severn Trent PLC	493	16 198	0,70
Veolia Environnement S.A.	1 132	36 872	1,61
		85 563	3,73
Total des actions ordinaires (coût identifié, 2 169 984 \$)		2 250 147	98,17
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 169 984 \$) (k)		2 250 147	98,17
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		41 954	1,83
ACTIF NET		2 292 101	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Global New Discovery Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Howmet Aerospace, Inc.	2 256	126 923	2,14
Melrose Industries PLC	9 527	71 331	1,20
Singapore Technologies Engineering Ltd.	15 600	43 109	0,73
Teledyne Technologies, Inc.	141	59 004	0,99
		300 367	5,06
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	3 422	56 724	0,96
Skechers USA, Inc., "A"	1 105	68 996	1,16
		125 720	2,12
Industrie automobile			
Lear Corp.	356	47 313	0,80
LKQ Corp.	2 233	104 214	1,75
		151 527	2,55
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
B3 S.A. - Brasil Bolsa Balcao	27 440	72 499	1,22
Cboe Global Markets, Inc.	361	66 370	1,12
Euronext N.V.	1 097	96 589	1,62
		235 458	3,96
Services aux entreprises			
Gruppo Mutuonline S.p.A.	945	32 578	0,55
Keywords Studios PLC	2 125	44 317	0,75
NS Solutions Corp.	3 700	123 491	2,08
RS Group PLC	7 083	70 169	1,18
WNS (Holdings) Ltd., ADR	639	44 315	0,74
		314 870	5,30
Télévision par câble			
Cable One, Inc.	71	38 974	0,66
Produits chimiques			
Borregaard ASA	3 461	59 036	0,99
Element Solutions, Inc.	2 716	60 377	1,02
IMCD Group N.V.	325	49 469	0,83
UPL Ltd.	8 409	54 288	0,92
		223 170	3,76
Logiciels			
Dun & Bradstreet Holdings, Inc.	3 352	38 850	0,65
Kinaxis, Inc.	385	46 883	0,79

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global New Discovery Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels, suite			
OBIC Co. Ltd.	200	30 683	0,52
Totvs S.A.	4 400	27 993	0,47
		144 409	2,43
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	828	57 880	0,97
Kardex AG	187	47 619	0,80
Rapid7, Inc.	728	40 062	0,68
		145 561	2,45
Construction			
Allegion PLC	368	45 591	0,77
AZEK Co., Inc.	1 719	66 285	1,12
Breedon Group PLC	14 067	64 099	1,08
Mid-America Apartment Communities, Inc., REIT	364	46 002	0,77
Summit Materials, Inc., "A"	1 960	70 913	1,19
		292 890	4,93
Services de consommation			
Boyd Group Services, Inc.	322	69 212	1,16
Conteneurs			
Mayr-Melnhof Karton AG	230	30 424	0,51
Verallia S.A.	1 234	43 571	0,73
		73 995	1,24
Équipements électriques			
nVent Electric PLC	1 189	71 388	1,20
Électronique			
ASM International N.V.	208	116 034	1,95
Énergie - Sociétés indépendantes			
Diamondback Energy, Inc.	503	77 331	1,30
Ingénierie - Construction			
Corporacion Inmobiliaria Vesta S.A.B. de C.V.	13 407	50 983	0,86
Jacobs Solutions, Inc.	696	93 800	1,58
JGC Corp.	3 200	37 511	0,63
		182 294	3,07
Divertissement			
CTS Eventim AG	864	58 684	0,99
Lottery Corp. Ltd.	18 498	61 127	1,03
		119 811	2,02
Alimentation et boissons			
Bakkafrost P/F	884	49 353	0,83
Cranswick PLC	2 609	132 700	2,23
S Foods, Inc.	1 700	38 310	0,65
Toyo Suisan Kaisha Ltd.	700	36 414	0,61
Universal Robina Corp.	22 470	44 505	0,75
		301 282	5,07
Marchandises générales			
B&M European Value Retail S.A.	11 584	75 831	1,28
Assurances			
AUB Group Ltd.	5 828	116 307	1,96
Internet			
Digital Garage, Inc.	1 200	28 925	0,48
Scout24 AG	840	62 228	1,05
		91 153	1,53
Machines et outils			
AGCO Corp.	442	54 070	0,91
Azbil Corp.	900	29 106	0,49
IDEX Corp.	209	44 204	0,74

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global New Discovery Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Machines et outils, suite			
Ingersoll Rand, Inc.	1 124	89 763	1,51
Interpump Group S.p.A	818	40 360	0,68
RB Global, Inc.	1 127	72 094	1,21
SIG Combibloc Group AG	2 053	42 904	0,72
VAT Group AG	80	37 305	0,63
Veralto Corp.	864	66 260	1,12
Wabtec Corp.	835	109 861	1,85
Zurn Elkay Water Solutions Corp.	1 032	30 599	0,52
		616 526	10,38
Technologies et services médicaux et de santé			
AS ONE Corp.	1 000	37 843	0,64
ICON PLC	402	104 870	1,76
Selcuk Ecza Deposu Ticaret ve Sanayi A.S.	18 313	36 813	0,62
		179 526	3,02
Équipements médicaux			
Bruker BioSciences Corp.	753	53 847	0,91
Envista Holdings Corp.	1 853	43 545	0,73
Gerresheimer AG	699	71 688	1,21
STERIS PLC	483	105 753	1,78
Tecan Group AG	87	33 260	0,56
		308 093	5,19
Services pétroliers			
TechnipFMC PLC	1 757	33 980	0,57
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Shizuoka Financial Group, Inc.	6 600	60 434	1,02
Lutte contre la pollution			
Daiseki Co. Ltd.	1 500	42 851	0,72
GFL Environmental, Inc.	3 474	118 012	1,99
		160 863	2,71
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	321	47 353	0,80
Immobilier			
Big Yellow Group PLC, REIT	3 035	43 906	0,74
Catena AB	997	42 330	0,71
LEG Immobilien SE	476	39 750	0,67
Sun Communities, Inc., REIT	481	60 293	1,01
Tritax Big Box PLC, REIT	22 858	47 884	0,81
Unite Group PLC, REIT	4 560	58 157	0,98
		292 320	4,92
Restaurants			
Sodexo	425	48 043	0,81
Yum China Holdings, Inc.	878	30 370	0,51
		78 413	1,32
Produits chimiques spéciaux			
Axalta Coating Systems Ltd.	1 791	58 064	0,98
Chemours Co.	2 026	61 125	1,03
Croda International PLC	533	32 457	0,54
Essentra PLC	23 885	52 366	0,88
Symrise AG	783	81 183	1,37
		285 195	4,80
Magasins spécialisés			
Burlington Stores, Inc.	371	70 917	1,19
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios S.A.	13 494	75 880	1,28
NISHIMATSUYA CHAIN Co., Ltd.	2 800	40 541	0,68

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global New Discovery Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Magasins spécialisés, suite			
ZOZO, Inc.	1 500	32 951	0,56
		220 289	3,71
Télécommunications mobiles			
Wireless Infrastructure Italian S.p.A.	5 226	63 509	1,07
Transport par camion			
Saia, Inc.	85	38 299	0,64
XPO, Inc.	518	44 258	0,75
		82 557	1,39
Total des actions ordinaires (coût identifié, 5 456 415 \$)		5 696 642	95,90
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 5 456 415 \$) (k)		5 696 642	95,90
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		243 531	4,10
ACTIF NET		5 940 173	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Aérospatiale et défense			
HEICO Corp., 5,35 %, 1/08/2033	USD 705 000	716 472	0,16
Spirit AeroSystems, Inc., 9,75 %, 15/11/2030	482 000	505 888	0,12
Thales S.A., 3,625 %, 14/06/2029	EUR 400 000	441 910	0,10
Thales S.A., 4,25 %, 18/10/2031	400 000	457 724	0,10
		2 121 994	0,48
Industrie de la confection			
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,25 %, 7/09/2029	600 000	659 583	0,15
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,5 %, 7/09/2033	200 000	223 455	0,05
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032	USD 264 000	211 145	0,05
		1 094 183	0,25
Créances adossées à des actifs et titrisées			
ACREC 2021-FL1 Ltd., "C", FLR, 7,599 %, 16/10/2036	1 022 500	985 987	0,22
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "C", FLR, 7,448 %, 15/12/2035	204 000	198 269	0,04
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL2, "C", FLR, 7,398 %, 15/05/2036	851 000	818 455	0,19
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "C", FLR, 7,646 %, 15/01/2037	1 290 500	1 244 603	0,28
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "D", FLR, 8,346 %, 15/01/2037	825 000	764 847	0,17
AREIT 2022-CRE6 Trust, "C", FLR, 7,495 %, 20/01/2037	252 000	240 481	0,05
AREIT 2022-CRE6 Trust, "D", FLR, 8,195 %, 20/01/2037	269 000	253 511	0,06
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "B", FLR, 7,498 %, 15/12/2038	306 500	300 197	0,07
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "C", FLR, 7,747 %, 15/12/2038	277 500	270 677	0,06
Business Jet Securities LLC, 2020-1A, "A", 2,981 %, 15/11/2035	182 939	177 336	0,04
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "A", 2,162 %, 15/04/2036	314 722	294 417	0,07
Capital Automotive, 2020-1A, "A4", REIT, 3,19 %, 15/02/2050	344 754	332 183	0,08
Colt Funding LLC, 2024-1, "A1", 5,835 %, 25/02/2069	846 986	846 976	0,19
Commercial Mortgage Pass-Through Certificates, 2020-BNK28, "AS", 2,14 %, 15/03/2063	524 000	432 949	0,10
Consumers 2023 Securitization Funding LLC, 5,55 %, 1/03/2028	747 000	750 001	0,17
Empire District Bondco LLC, 4,943 %, 1/01/2033	848 000	849 600	0,19
Fortress CBO Investments Ltd., 2022-FL3, "AS", FLR, 7,595 %, 23/02/2039	449 000	436 042	0,10
Hartwick Park CLO Ltd., 2023-1A, "A", FLR, 6,97 %, 21/01/2036	1 033 000	1 032 834	0,23
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "B", FLR, 7,448 %, 15/07/2036	845 500	816 587	0,18
MF1 2024-FL14 LLC, "B", FLR, 8,057 %, 19/03/2039	374 016	373 081	0,08

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
MF1 2021-FL5 Ltd., "C", FLR, 7,146 %, 15/07/2036	USD	662 500	636 398	0,14
MF1 2021-FL6 Ltd., "AS", FLR, 6,899 %, 16/07/2036		1 500 000	1 470 934	0,33
MF1 2021-FL6 Ltd., "B", FLR, 7,099 %, 16/07/2036		2 600 000	2 526 387	0,57
MF1 2022-FL8 Ltd., "C", FLR, 7,536 %, 19/02/2037		446 286	428 681	0,10
MF1 2024-FL14 LLC, "AS", FLR, 7,658 %, 19/03/2039		391 348	390 370	0,09
MF1 2024-FL14 Ltd., "A", FLR, 7,055 %, 19/03/2039		915 000	912 712	0,21
Neuberger Berman CLO Ltd., 2023-53A, "B", FLR, 7,589 %, 24/10/2032		863 874	865 278	0,20
OBX Trust, 2024-NQM1, "A1", 5,928 %, 25/11/2063		576 284	579 362	0,13
OBX Trust, 2024-NQM2, "A1", 5,878 %, 25/12/2063		1 422 625	1 425 203	0,32
Onslow Bay Financial LLC OBX Trust, 2024-NQM1, "A2", 6,253 %, 25/11/2063		103 925	104 571	0,02
RAC Bond Co. PLC, 4,87 %, 6/05/2026	GBP	210 000	259 518	0,06
Shelter Growth CRE 2021-FL3 Ltd., "C", FLR, 7,598 %, 15/09/2036	USD	687 500	657 999	0,15
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "B", FLR, 7,249 %, 18/04/2038		1 147 000	1 083 425	0,24
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "C", FLR, 7,549 %, 18/04/2038		238 000	214 689	0,05
TPG Real Estate Finance, 2021-FL4, "B", FLR, 7,296 %, 15/03/2038		800 000	773 931	0,18
Verus Securitization Trust, 2014-1, "A1", 5,712 %, 25/01/2069		926 548	925 872	0,21
Westlake Automobile Receivables Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 6,196 %, 15/06/2026		99 835	99 911	0,02
			24 774 274	5,59
Industrie automobile				
Hyundai Capital America, 6,375 %, 8/04/2030		365 000	388 599	0,09
LKQ Corp., 6,25 %, 15/06/2033		223 000	232 679	0,05
Mercedes-Benz Finance Co. Ltd., 3,25 %, 10/01/2032	EUR	330 000	357 931	0,08
RAC Bond Co. PLC, 5,25 %, 4/11/2027	GBP	900 000	1 055 577	0,24
Volkswagen International Finance N.V., 7,5 %, 6/09/2172	EUR	300 000	351 742	0,08
Volkswagen International Finance N.V., 7,875 %, 6/09/2172		100 000	121 664	0,03
Volkswagen Leasing GmbH, 4 %, 11/04/2031		410 000	448 877	0,10
			2 957 069	0,67
Radio-télévision				
Discovery Communications LLC, 4,125 %, 15/05/2029	USD	672 000	637 757	0,14
Prosus N.V., 4,027 %, 3/08/2050		600 000	383 677	0,09
Ubisoft Entertainment S.A., 0,878 %, 24/11/2027	EUR	1 100 000	982 221	0,22
WarnerMedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032	USD	676 000	618 953	0,14
Weibo Corp., 3,375 %, 8/07/2030		200 000	173 488	0,04
			2 796 096	0,63
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Charles Schwab Corp., 5,643 % jusqu'au 19/05/2028, FLR jusqu'au 19/05/2029		207 000	211 793	0,05
Charles Schwab Corp., 6,136 % jusqu'au 24/08/2033, FLR jusqu'au 24/08/2034		318 000	336 081	0,08
Low Income Investment Fund, 3,386 %, 1/07/2026		85 000	80 093	0,02
Low Income Investment Fund, 3,711 %, 1/07/2029		230 000	201 669	0,04
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		954 000	879 225	0,20
LSEG Netherlands B.V., 4,231 %, 29/09/2030	EUR	320 000	364 219	0,08
			2 073 080	0,47
Construction				
Foundation Construction Materials LLC, 6 %, 1/03/2029	USD	748 000	657 305	0,15
HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A., 4,875 %, 21/11/2033	EUR	270 000	314 181	0,07
Holcim Sterling Finance (Netherlands) B.V., 2,25 %, 4/04/2034	GBP	520 000	503 188	0,11
Imerys S.A., 4,75 %, 29/11/2029	EUR	400 000	445 356	0,10
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 5,25 %, 15/07/2028	USD	780 000	749 424	0,17
Standard Industries, Inc., 4,75 %, 15/01/2028		774 000	740 271	0,17
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030		464 000	430 642	0,10
			3 840 367	0,87
Services aux entreprises				
Corning, Inc., 4,125 %, 15/05/2031	EUR	510 000	573 721	0,13
Euronet Worldwide, Inc., 1,375 %, 22/05/2026		330 000	335 802	0,07
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049	USD	417 000	363 152	0,08

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services aux entreprises, suite				
Mastercard, Inc., 3,3 %, 26/03/2027	USD	229 000	222 173	0,05
Mastercard, Inc., 3,85 %, 26/03/2050		193 000	165 025	0,04
Visa, Inc., 3,65 %, 15/09/2047		366 000	304 606	0,07
			1 964 479	0,44
Télévision par câble				
Cable One, Inc., 4 %, 15/11/2030		693 000	557 865	0,13
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 4,908 %, 23/07/2025		208 000	206 156	0,05
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 4,8 %, 1/03/2050		320 000	244 290	0,05
Cox Communications, Inc., 5,45 %, 15/09/2028		534 000	544 937	0,12
SES S.A., 3,5 %, 14/01/2029	EUR	790 000	837 132	0,19
Summer BidCo B.V., 10 %, 15/02/2029 (p)		100 000	109 090	0,02
Ziggo Bond Finance B.V., 3,375 %, 28/02/2030		1 210 000	1 108 438	0,25
			3 607 908	0,81
Produits chimiques				
Arkema S.A., 4,25 %, 20/05/2030		300 000	338 459	0,08
Arkema S.A., 1,5 % jusqu'au 21/01/2026, FLR jusqu'au 21/01/2171		400 000	405 272	0,09
Sasol Financing (USA) LLC, 4,375 %, 18/09/2026	USD	290 000	270 970	0,06
SCIH Salt Holdings, Inc., 6,625 %, 1/05/2029		724 000	657 648	0,15
Synthos S.A., 2,5 %, 7/06/2028	EUR	476 000	444 114	0,10
			2 116 463	0,48
Logiciels				
Microsoft Corp., 2,525 %, 1/06/2050	USD	301 000	200 871	0,05
Oracle Corp., 4 %, 15/07/2046		303 000	244 466	0,05
			445 337	0,10
Logiciels - Systèmes				
Apple, Inc., 3,2 %, 11/05/2027		412 000	398 181	0,09
Apple, Inc., 4,5 %, 23/02/2036		405 000	411 649	0,09
			809 830	0,18
Conglomérats				
nVent Finance S.à r.l., 5,65 %, 15/05/2033		326 000	334 600	0,08
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		777 000	788 381	0,18
Siemens Financieringsmaatschappij N.V., 3,625 %, 24/02/2043	EUR	300 000	333 314	0,07
TriMas Corp., 4,125 %, 15/04/2029	USD	1 289 000	1 147 624	0,26
Veralto Corp., 4,15 %, 19/09/2031	EUR	289 000	321 511	0,07
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,7 %, 15/09/2028	USD	389 000	385 287	0,09
			3 310 717	0,75
Biens de consommation				
JAB Holdings B.V., 2,25 %, 19/12/2039	EUR	700 000	577 341	0,13
Kenvue, Inc., 5,05 %, 22/03/2053	USD	637 000	642 354	0,15
			1 219 695	0,28
Services de consommation				
Compass Group PLC, 3,25 %, 6/02/2031	EUR	160 000	172 635	0,04
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,75 %, 15/01/2029	USD	693 000	514 740	0,12
Rentokil Initial PLC, 5 %, 27/06/2032	GBP	530 000	666 456	0,15
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPF, 0 %, 15/02/2043	USD	2 741 932	834 644	0,19
TriNet Group, Inc., 3,5 %, 1/03/2029		1 226 000	1 082 007	0,24
Verisure Midholding AB, 5,25 %, 15/02/2029	EUR	480 000	494 330	0,11
			3 764 812	0,85
Conteneurs				
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 3 %, 1/09/2029		985 000	830 302	0,19
Équipements électriques				
Arrow Electronics, Inc., 2,95 %, 15/02/2032	USD	380 000	321 478	0,07
Électronique				
Intel Corp., 5,7 %, 10/02/2053		340 000	357 665	0,08
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 3,4 %, 1/05/2030		176 000	160 866	0,04

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Électronique, suite				
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 5 %, 15/01/2033	USD	81 000	79 852	0,02
SK hynix, Inc., 6,375 %, 17/01/2028		400 000	415 659	0,09
			1 014 042	0,23
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Dua Capital Ltd. (Fédération de Malaisie), 2,78 %, 11/05/2031		1 278 000	1 106 873	0,25
Eskom Holdings SOC Ltd. (République d'Afrique du Sud), 7,125 %, 11/02/2025		542 000	539 257	0,12
Export-Import Bank of India, 2,25 %, 13/01/2031		543 000	449 224	0,10
First Abu Dhabi Bank PJSC, 6,32 % jusqu'au 4/04/2031, FLR jusqu'au 4/04/2034		492 000	505 221	0,12
Indian Railway Finance Corp., 2,8 %, 10/02/2031		406 000	345 441	0,08
Ipoteka Bank (République d'Ouzbékistan), 5,5 %, 19/11/2025		442 000	416 541	0,09
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 3,5 %, 14/04/2033		417 000	341 114	0,08
KazMunayGas National Co., JSC (République du Kazakhstan), 6,375 %, 24/10/2048		400 000	368 037	0,08
MVM Energetika Zartkoruen Mukodo Reszvenytarsasag (République de Hongrie), 0,875 %, 18/11/2027	EUR	301 000	279 728	0,06
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC, 7,625 %, 8/11/2028 (d)	USD	878 000	469 730	0,11
Oryx Funding Ltd. (Sultanat d'Oman), 5,8 %, 3/02/2031		865 000	857 431	0,19
Petroleos Mexicanos, 5,95 %, 28/01/2031		650 000	512 899	0,12
Petroleos Mexicanos, 10 %, 7/02/2033		306 000	302 618	0,07
Petroleos Mexicanos, 7,69 %, 23/01/2050		300 000	209 732	0,05
REC Ltd. (République de l'Inde), 5,625 %, 11/04/2028		360 000	363 222	0,08
Southern Gas Corridor CJSC (République d'Azerbaïdjan), 6,875 %, 24/03/2026		300 000	303 660	0,07
SPP-Distribucia A.S. (République de Slovaquie), 1 %, 9/06/2031	EUR	1 060 000	851 637	0,19
State Oil Company of the Azerbaijan Republic, 6,95 %, 18/03/2030	USD	643 000	662 290	0,15
Turkiye Ithracat Kredi Bankasi A.S., 5,75 %, 6/07/2026		422 000	409 230	0,09
			9 293 885	2,10
Obligations souveraines des marchés émergents				
République de l'Inde, 7,18 %, 14/08/2033	INR	123 000 000	1 479 464	0,33
République arabe d'Égypte, 7,5 %, 16/02/2061	USD	486 000	278 450	0,06
République tchèque, 2,5 %, 25/08/2028	CZK	92 830 000	3 848 179	0,87
République tchèque, 2 %, 13/10/2033		29 250 000	1 087 268	0,25
République dominicaine, 4,875 %, 23/09/2032	USD	730 000	650 664	0,15
République dominicaine, 5,3 %, 21/01/2041		637 000	535 080	0,12
République dominicaine, 5,875 %, 30/01/2060		425 000	359 900	0,08
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2027	BRL	6 675 000	1 351 087	0,31
République fédérative du Brésil, 10 %, 1/01/2029		19 400 000	3 879 295	0,88
Hellenic Republic (République de Grèce), 3,375 %, 15/06/2034	EUR	8 582 000	9 281 989	2,10
Hellenic Republic (République de Grèce), 4,375 %, 18/07/2038		1 920 000	2 247 737	0,51
Royaume du Maroc, 5,95 %, 8/03/2028	USD	305 000	310 822	0,07
Royaume d'Arabie Saoudite, 5 %, 18/01/2053		300 000	266 250	0,06
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031	UYU	117 295 000	2 821 728	0,64
République orientale d'Uruguay, 9,75 %, 20/07/2033		44 234 000	1 164 557	0,26
République populaire de Chine, 3,13 %, 21/11/2029	CNY	21 200 000	3 074 100	0,69
République populaire de Chine, 2,88 %, 25/02/2033		41 670 000	5 990 850	1,35
République d'Angola, 9,125 %, 26/11/2049	USD	600 000	474 184	0,11
République du Bénin, 6,875 %, 19/01/2052	EUR	547 000	462 664	0,10
République du Chili, 2,55 %, 27/07/2033	USD	350 000	288 198	0,06
République de Côte d'Ivoire, 8,25 %, 30/01/2037		200 000	198 700	0,04
République de Côte d'Ivoire, 6,875 %, 17/10/2040	EUR	874 000	787 362	0,18
République de Hongrie, 6,125 %, 22/05/2028	USD	369 000	379 553	0,09
République de Hongrie, 5,5 %, 16/06/2034		348 000	344 520	0,08
République de Corée, 2,375 %, 10/12/2027	KRW	2 950 000 000	2 140 423	0,48
République de Corée, 1,875 %, 10/06/2029		15 683 270 000	10 940 729	2,47
République de Corée, 1,375 %, 10/06/2030		13 208 470 000	8 775 580	1,98
République du Paraguay, 5,6 %, 13/03/2048	USD	1 300 000	1 156 978	0,26
République de Roumanie, 5,875 %, 30/01/2029		182 000	184 167	0,04

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations souveraines des marchés émergents, suite				
République de Roumanie, 2 %, 14/04/2033	EUR	300 000	246 043	0,06
République de Roumanie, 6 %, 25/05/2034	USD	700 000	699 009	0,16
République de Serbie, 6,5 %, 26/09/2033		200 000	203 868	0,05
République de Serbie, 2,05 %, 23/09/2036	EUR	223 000	166 890	0,04
Sultanat d'Oman, 6,75 %, 17/01/2048	USD	200 000	200 901	0,05
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 3/06/2027	MXN	136 200 000	7 489 951	1,69
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031		71 200 000	3 823 822	0,86
États-Unis du Mexique, 6,338 %, 4/05/2053	USD	200 000	199 361	0,04
			77 790 323	17,57
Énergie - Sociétés indépendantes				
Medco Bell Pte. Ltd., 6,375 %, 30/01/2027		334 000	321 628	0,07
Occidental Petroleum Corp., 6,45 %, 15/09/2036		572 000	610 181	0,14
Pioneer Natural Resources Co., 2,15 %, 15/01/2031		532 000	453 185	0,10
Santos Finance Ltd., 6,875 %, 19/09/2033		399 000	424 794	0,10
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 4 %, 15/08/2026		400 000	376 668	0,09
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 3,25 %, 15/08/2030		336 000	276 545	0,06
			2 463 001	0,56
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets America, Inc., 4,812 %, 13/02/2033		320 000	319 682	0,07
BP Capital Markets B.V., 4,323 %, 12/05/2035	EUR	350 000	397 528	0,09
BP Capital Markets B.V., 0,933 %, 4/12/2040		190 000	132 735	0,03
Eni S.p.A., 3,875 %, 15/01/2034		414 000	453 133	0,10
Exxon Mobil Corp., 1,408 %, 26/06/2039		430 000	337 524	0,08
			1 640 602	0,37
Ingénierie - Construction				
John Deere Bank S.A., 5,125 %, 18/10/2028	GBP	317 000	412 975	0,09
Divertissement				
Motion Finco S.à r.l., 7,375 %, 15/06/2030	EUR	634 000	707 336	0,16
Établissements financiers				
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,25 %, 15/04/2026	USD	461 000	445 850	0,10
CTP N.V., 4,75 %, 5/02/2030	EUR	120 000	130 744	0,03
Dar Al-Arkan Sukuk Co. Ltd., 6,875 %, 26/02/2027	USD	200 000	198 000	0,05
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		478 176	460 842	0,10
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		523 306	504 336	0,11
Grand City Properties S.A., 1,5 % jusqu'au 9/06/2026, FLR jusqu'au 9/12/2069	EUR	500 000	286 034	0,07
Heimstaden Bostad Treasury B.V., 1 %, 13/04/2028		520 000	434 811	0,10
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 3 %, 14/01/2025		280 000	269 311	0,06
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,375 %, 4/09/2026		550 000	455 839	0,10
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,875 % jusqu'au 30/01/2027, FLR jusqu'au 30/01/2171		815 000	158 539	0,04
SBB Treasury Oyj, 0,75 %, 14/12/2028		147 000	99 885	0,02
VGP N.V., 1,5 %, 8/04/2029		400 000	356 626	0,08
Vonovia SE, 5,5 %, 18/01/2036	GBP	300 000	374 578	0,08
			4 175 395	0,94
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V., 2 %, 23/01/2035	EUR	360 000	345 037	0,08
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4,375 %, 15/04/2038	USD	646 000	614 390	0,14
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 5,55 %, 23/01/2049		311 000	329 127	0,07
Bacardi-Martini B.V., 5,4 %, 15/06/2033		799 000	803 026	0,18
Central American Bottling Corp., 5,25 %, 27/04/2029		539 000	503 496	0,11
Constellation Brands, Inc., 4,75 %, 1/12/2025		206 000	205 202	0,05
Constellation Brands, Inc., 3,15 %, 1/08/2029		175 000	161 584	0,04
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		333 000	277 838	0,06
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3,625 %, 15/01/2032		352 000	299 643	0,07
JDE Peet's N.V., 4,5 %, 23/01/2034	EUR	120 000	135 391	0,03
JM Smucker Co., 6,5 %, 15/11/2053	USD	237 000	267 780	0,06

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Alimentation et boissons, suite				
Kraft Heinz Foods Co., 3,875 %, 15/05/2027	USD	382 000	373 466	0,09
United Natural Foods, Inc., 6,75 %, 15/10/2028		602 000	505 680	0,11
			4 821 660	1,09
Jeux et hôtellerie				
IHG Finance LLC, 4,375 %, 28/11/2029	EUR	110 000	123 542	0,03
Las Vegas Sands Corp., 3,9 %, 8/08/2029	USD	521 000	480 888	0,11
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031		495 000	429 806	0,09
VICI Properties LP, REIT, 4,95 %, 15/02/2030		219 000	212 307	0,05
			1 246 543	0,28
Industrie				
Arcadis N.V., 4,875 %, 28/02/2028	EUR	387 000	435 947	0,10
Trustees of the University of Pennsylvania, 2,396 %, 1/10/2050	USD	264 000	165 369	0,04
			601 316	0,14
Assurances				
Allianz SE, 4,851 % jusqu'au 26/07/2034, FLR jusqu'au 26/07/2054	EUR	500 000	553 874	0,13
Allianz SE, 3,2 % jusqu'au 30/04/2028, FLR jusqu'au 30/04/2171	USD	600 000	478 666	0,11
ASR Nederland N.V., 7 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2043	EUR	490 000	598 056	0,13
Assicurazioni Generali S.p.A., 3,547 %, 15/01/2034		800 000	861 586	0,19
Axa S.A., 6,375 % jusqu'au 16/01/2034, FLR jusqu'au 16/07/2172		406 000	446 991	0,10
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042	USD	660 000	564 903	0,13
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		355 000	364 462	0,08
Groupe des Assurances du Credit Mutuel, 1,85 % jusqu'au 21/04/2032, FLR jusqu'au 21/04/2042	EUR	900 000	786 837	0,18
Sogecap S.A., 6,5 % jusqu'au 16/05/2034, FLR jusqu'au 16/05/2044		100 000	117 400	0,03
			4 772 775	1,08
Assurances - Santé				
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035	USD	450 000	450 048	0,10
Assurances IARD				
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6,75 %, 15/10/2027		577 000	563 337	0,13
American International Group, Inc., 5,125 %, 27/03/2033		543 000	549 556	0,12
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 3,9 %, 28/02/2052		350 000	275 884	0,06
Arthur J. Gallagher & Co., 6,5 %, 15/02/2034		224 000	245 724	0,06
Arthur J. Gallagher & Co., 6,75 %, 15/02/2054		299 000	345 618	0,08
Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,25 %, 6/12/2027	CAD	825 000	601 686	0,14
Hub International Ltd., 7,375 %, 31/01/2032	USD	478 000	489 518	0,11
QBE Insurance Group Ltd., 2,5 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2038	GBP	394 000	422 136	0,09
			3 493 459	0,79
Obligations quasi souveraines du marché international				
Belfius Bank S.A. (Royaume de Belgique), 3,75 %, 22/01/2029	EUR	400 000	432 999	0,10
Belfius Bank S.A. (Royaume de Belgique), 4,125 %, 12/09/2029		400 000	446 678	0,10
Deutsche Bahn Finance GmbH, 3,375 %, 29/01/2038		100 000	108 356	0,02
Enbw International Finance B.V. (République fédérale d'Allemagne), 4,3 %, 23/05/2034		275 000	313 182	0,07
Logicor Financing S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 4,625 %, 25/07/2028		200 000	218 047	0,05
Logicor Financing S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 1,625 %, 17/01/2030		450 000	412 682	0,09
NBN Co. Ltd. (Commonwealth d'Australie), 5,75 %, 6/10/2028	USD	489 000	508 722	0,12
NBN Co. Ltd. (Commonwealth d'Australie), 4,375 %, 15/03/2033	EUR	363 000	414 560	0,09
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties, 2,5 %, 15/10/2031	USD	480 000	386 441	0,09
P3 Group S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 1,625 %, 26/01/2029	EUR	330 000	311 125	0,07
			3 552 792	0,80
Obligations souveraines du marché international				
Commonwealth d'Australie, 3,25 %, 21/06/2039	AUD	5 591 000	3 258 098	0,74
Commonwealth d'Australie, 2,75 %, 21/05/2041		2 594 000	1 377 095	0,31
République fédérale d'Allemagne, 2,1 %, 12/04/2029	EUR	4 000 000	4 334 818	0,98
République fédérale d'Allemagne, 2,6 %, 15/08/2033		1 400 000	1 574 298	0,36
Gouvernement des Bermudes, 2,375 %, 20/08/2030	USD	346 000	291 090	0,07
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		858 000	832 260	0,19

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations souveraines du marché international, suite				
Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1/06/2030	CAD	8 322 000	5 455 894	1,23
Gouvernement du Japon, 0,3 %, 20/12/2039	JPY	1 030 350 000	6 042 578	1,36
Gouvernement du Japon, 1,7 %, 20/06/2044		461 000 000	3 223 930	0,73
Gouvernement du Japon, 0,3 %, 20/06/2046		384 450 000	1 972 585	0,45
Gouvernement du Japon, 0,4 %, 20/03/2050		806 750 000	3 958 765	0,89
Gouvernement de Nouvelle-Zélande, 3,5 %, 14/04/2033	NZD	1 939 000	1 091 238	0,25
Royaume de Belgique, 3 %, 22/06/2033	EUR	1 939 000	2 149 021	0,48
Royaume de Belgique, 0,4 %, 22/06/2040		1 764 000	1 251 263	0,28
Royaume d'Espagne, 3,15 %, 30/04/2033		3 629 000	3 956 766	0,89
Royaume d'Espagne, 3,25 %, 30/04/2034		2 076 000	2 264 318	0,51
Royaume d'Espagne, 3,9 %, 30/07/2039		4 206 000	4 738 587	1,07
Royaume d'Espagne, 1 %, 31/10/2050		2 699 000	1 585 858	0,36
République de Finlande, 2,95 %, 15/04/2055		1 400 000	1 511 367	0,34
République d'Islande, 2,5 %, 15/04/2024	ISK	147 000 000	1 055 306	0,24
République italienne, 4,1 %, 1/02/2029	EUR	10 124 000	11 446 352	2,58
République italienne, 1,45 %, 1/03/2036		2 393 000	1 985 475	0,45
République italienne, 4,15 %, 1/10/2039		1 424 000	1 533 993	0,35
Titres du Trésor britannique, 0,375 %, 22/10/2030	GBP	7 811 000	7 989 111	1,80
Titres du Trésor britannique, 1,75 %, 7/09/2037		1 252 000	1 196 659	0,27
Titres du Trésor britannique, 1,25 %, 22/10/2041		1 101 000	868 294	0,20
			76 945 019	17,38
Autorités locales				
Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18/06/2050	CAD	500 000	297 523	0,07
Machines et outils				
CNH Industrial Capital LLC, 5,5 %, 12/01/2029	USD	457 000	469 974	0,11
Sarens Finance Co. N.V., 5,75 %, 21/02/2027	EUR	710 000	713 586	0,16
			1 183 560	0,27
Grandes banques				
Banco BPM S.p.A., 4,625 %, 29/11/2027		270 000	300 739	0,07
Bank of America Corp., 5,202 % jusqu'au 25/04/2028, FLR jusqu'au 25/04/2029	USD	551 000	555 507	0,13
Bank of America Corp., 2,687 % jusqu'au 22/04/2031, FLR jusqu'au 22/04/2032		757 000	642 633	0,14
BNP Paribas, 4,75 %, 13/11/2032	EUR	500 000	572 765	0,13
BNP Paribas S.A., FLR, 5,97 %, 23/03/2172	USD	970 000	965 635	0,22
Capital One Financial Corp., 6,377 % jusqu'au 8/06/2033, FLR jusqu'au 8/06/2034		319 000	331 451	0,07
Commonwealth Bank of Australia, 2,688 %, 11/03/2031		752 000	625 354	0,14
Credit Agricole S.A., 6,316 % jusqu'au 3/10/2028, FLR jusqu'au 3/10/2029		503 000	524 530	0,12
Credit Agricole S.A., 3,75 %, 22/01/2034	EUR	400 000	437 048	0,10
Goldman Sachs Group, Inc., 2,383 % jusqu'au 21/07/2031, FLR jusqu'au 21/07/2032	USD	270 000	222 628	0,05
HSBC Holdings PLC, 2,099 % jusqu'au 4/06/2025, FLR jusqu'au 4/06/2026		300 000	286 866	0,06
HSBC Holdings PLC, 4,375 %, 23/11/2026		259 000	253 779	0,06
HSBC Holdings PLC, 6,8 %, 14/09/2031	GBP	250 000	341 312	0,08
HSBC Holdings PLC, 4,856 % jusqu'au 23/05/2032, FLR jusqu'au 23/05/2033	EUR	450 000	517 783	0,12
JPMorgan Chase & Co., 1,47 % jusqu'au 22/09/2026, FLR jusqu'au 22/09/2027	USD	334 000	304 872	0,07
JPMorgan Chase & Co., 5,04 % jusqu'au 23/01/2027, FLR jusqu'au 23/01/2028		336 000	337 437	0,08
JPMorgan Chase & Co., 1,953 % jusqu'au 4/02/2031, FLR jusqu'au 4/02/2032		549 000	448 136	0,10
JPMorgan Chase & Co., 3,328 % jusqu'au 22/04/2051, FLR jusqu'au 22/04/2052		417 000	306 377	0,07
Lloyds Banking Group PLC, 4,75 % jusqu'au 21/09/2030, FLR jusqu'au 21/09/2031	EUR	280 000	317 368	0,07
mBank S.A., 0,966 % jusqu'au 21/09/2026, FLR jusqu'au 21/09/2027		500 000	472 131	0,11
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 1,412 %, 17/07/2025	USD	319 000	302 487	0,07
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		384 000	368 496	0,08
Morgan Stanley, 3,622 % jusqu'au 1/04/2030, FLR jusqu'au 1/04/2031		608 000	560 976	0,13
Morgan Stanley, 5,424 % jusqu'au 21/07/2033, FLR jusqu'au 21/07/2034		302 000	305 912	0,07
NatWest Markets PLC, 3,625 %, 9/01/2029	EUR	340 000	368 797	0,08
PNC Financial Services Group, Inc., 5,3 % jusqu'au 21/01/2027, FLR jusqu'au 21/01/2028	USD	236 000	238 089	0,05

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
PNC Financial Services Group, Inc., 5,676 % jusqu'au 22/01/2034, FLR jusqu'au 22/01/2035	USD	341 000	349 935	0,08
UBS Group AG, 2,746 % jusqu'au 11/02/2032, FLR jusqu'au 11/02/2033		1 150 000	942 791	0,21
UBS Group AG, 4,125 % jusqu'au 9/06/2032, FLR jusqu'au 9/06/2033	EUR	330 000	360 508	0,08
UBS Group AG, 9,25 % jusqu'au 13/11/2028, FLR jusqu'au 13/05/2172	USD	263 000	281 328	0,06
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026		430 000	407 356	0,09
UniCredit S.p.A., 4,3 %, 23/01/2031	EUR	700 000	760 643	0,17
Wells Fargo & Co., 3,526 % jusqu'au 24/03/2027, FLR jusqu'au 24/03/2028	USD	349 000	334 482	0,08
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033		364 000	319 498	0,07
			14 665 649	3,31
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance Corp., 2,6 %, 27/05/2030		522 000	456 720	0,10
Becton, Dickinson and Co., 4,298 %, 22/08/2032		294 000	283 222	0,06
CAB SELAS, 3,375 %, 1/02/2028	EUR	480 000	470 805	0,11
CVS Health Corp., 5,625 %, 21/02/2053	USD	260 000	258 884	0,06
HCA, Inc., 5,125 %, 15/06/2039		553 000	529 539	0,12
IQVIA, Inc., 6,25 %, 1/02/2029		303 000	315 337	0,07
New York Society for the Relief of the Ruptured & Crippled, 2,667 %, 1/10/2050		679 000	420 419	0,10
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 6,015 %, 15/11/2048		344 000	362 520	0,08
Star Parent, Inc., 9 %, 1/10/2030		602 000	633 005	0,14
Thermo Fisher Scientific (Finance I) B.V., 2 %, 18/10/2051	EUR	360 000	274 881	0,06
Thermo Fisher Scientific, Inc., 4,977 %, 10/08/2030	USD	285 000	291 346	0,07
			4 296 678	0,97
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 5,625 %, 1/04/2030		326 000	330 571	0,08
Baffinland Iron Mines Corp./Baffinland Iron Mines LP, 8,75 %, 15/07/2026		602 000	550 834	0,12
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031		347 000	299 923	0,07
GrafTech Finance, Inc., 9,875 %, 15/12/2028		462 000	345 257	0,08
Kaiser Aluminum Corp., 4,625 %, 1/03/2028		1 020 000	939 924	0,21
			2 466 509	0,56
Secteur intermédiaire				
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 5,927 %, 15/08/2030		444 000	461 532	0,10
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 6,036 %, 15/11/2033		234 000	245 668	0,06
DT Midstream, Inc., 4,125 %, 15/06/2029		1 190 000	1 093 310	0,25
Enbridge, Inc., 5,7 %, 8/03/2033		196 000	202 201	0,05
Enbridge, Inc., 8,5 % jusqu'au 15/01/2034, FLR jusqu'au 15/01/2084		387 000	413 740	0,09
Energy Transfer LP, 5,95 %, 15/05/2054		294 000	294 836	0,07
Plains All American Pipeline LP, 3,55 %, 15/12/2029		313 000	288 039	0,07
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		311 000	284 693	0,06
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		296 000	258 143	0,06
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 6,25 %, 15/01/2030		814 000	814 646	0,18
Venture Global LNG, Inc., 8,125 %, 1/06/2028		370 000	373 955	0,08
			4 730 763	1,07
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 3,5 %, 1/12/2047		118 577	111 044	0,02
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/11/2036–1/05/2052		5 813 532	4 933 069	1,11
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/07/2037–1/05/2052		3 883 152	3 290 284	0,76
Fannie Mae, UMBS, 3,5 %, 1/05/2049–1/06/2052		969 749	888 573	0,20
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/11/2051–1/07/2052		621 358	545 195	0,12
Fannie Mae, UMBS, 4 %, 1/06/2052–1/04/2053		921 486	867 455	0,20
Fannie Mae, UMBS, 4,5 %, 1/08/2052–1/04/2053		1 414 560	1 367 794	0,31
Fannie Mae, UMBS, 5 %, 1/09/2052–1/04/2053		751 460	741 805	0,17
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/11/2052–1/11/2053		1 663 113	1 671 301	0,37
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/12/2052–1/11/2053		708 101	718 001	0,16
Freddie Mac, 0,131 %, 25/01/2025 (i)		51 348 000	47 440	0,01
Freddie Mac, 0,265 %, 25/02/2025 (i)		18 119 000	29 264	0,01

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024
MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Freddie Mac, 3,444 %, 25/12/2027	USD	400 000	386 566	0,09
Freddie Mac, 0,263 %, 25/02/2028 (i)		17 700 000	104 143	0,02
Freddie Mac, 0,251 %, 25/04/2028 (i)		8 063 000	46 636	0,01
Freddie Mac, 5 %, 25/11/2028		971 986	997 408	0,22
Freddie Mac, 5,989 %, 25/03/2029		659 126	658 480	0,15
Freddie Mac, 5,978 %, 25/07/2029–25/09/2029		1 436 209	1 434 087	0,32
Freddie Mac, 5,979 %, 25/08/2029		587 539	586 460	0,13
Freddie Mac, 1,44 %, 25/01/2030 (i)		5 246 706	337 086	0,08
Freddie Mac, 1,21 %, 25/06/2030 (i)		3 916 595	224 850	0,05
Freddie Mac, 1,482 %, 25/06/2030 (i)		6 656 014	460 863	0,10
Freddie Mac, 4,94 %, 25/11/2030		864 024	886 829	0,20
Freddie Mac, 0,301 %, 25/11/2032 (i)		14 438 386	211 476	0,05
Freddie Mac, 0,299 %, 25/08/2033 (i)		11 377 213	164 360	0,04
Freddie Mac Multi-Family Structured Pass-Through Certificates K-511, "X-1", 0,612 %, 25/10/2028 (i)		4 880 205	95 475	0,02
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/06/2037–1/03/2052		3 262 140	2 635 111	0,59
Freddie Mac, UMBS, 4,5 %, 1/06/2038–1/07/2038		597 203	592 671	0,13
Freddie Mac, UMBS, 4 %, 1/12/2047–1/11/2052		1 228 513	1 157 916	0,26
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/06/2050–1/06/2053		3 608 354	3 160 754	0,72
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/06/2051–1/10/2052		2 337 259	1 967 979	0,45
Freddie Mac, UMBS, 5 %, 1/08/2052–1/10/2053		836 873	826 262	0,19
Freddie Mac, UMBS, 5,5 %, 1/09/2052–1/10/2053		895 953	898 895	0,21
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/10/2052		23 586	21 470	0,00
Freddie Mac, UMBS, 6 %, 1/11/2052–1/10/2053		1 156 252	1 172 933	0,27
Freddie Mac, UMBS, 6,5 %, 1/11/2053		424 646	434 808	0,10
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/08/2051–20/10/2052		1 786 938	1 545 148	0,35
Ginnie Mae, 2 %, 20/03/2052–20/06/2052		2 924 990	2 436 221	0,54
Ginnie Mae, 3 %, 20/05/2052–20/11/2052		1 016 989	908 497	0,21
Ginnie Mae, 4 %, 20/07/2052–20/11/2052		354 514	336 673	0,08
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/09/2052–20/12/2052		914 283	890 414	0,20
Ginnie Mae, 3,5 %, 20/10/2052–20/12/2052		869 307	801 635	0,18
Ginnie Mae, 5 %, 20/01/2053–20/09/2053		1 003 562	996 887	0,23
Ginnie Mae, 5,5 %, 20/02/2053–20/04/2053		674 370	678 956	0,15
Ginnie Mae, TBA, 2,5 %, 20/02/2054		1 275 000	1 102 249	0,25
Ginnie Mae, TBA, 6 %, 20/02/2054		375 000	380 720	0,09
Ginnie Mae, TBA, 6,5 %, 20/02/2054–20/03/2054		225 000	229 874	0,05
UMBS, TBA, 2 %, 25/02/2039–13/03/2054		975 000	821 287	0,18
UMBS, TBA, 2,5 %, 25/02/2039		475 000	437 408	0,10
UMBS, TBA, 6,5 %, 13/02/2054		125 000	127 958	0,03
UMBS, TBA, 3 %, 25/02/2054		25 000	21 879	0,00
UMBS, TBA, 3,5 %, 25/02/2054–25/03/2054		1 750 000	1 593 040	0,36
			47 983 589	10,84
Obligations municipales				
Iowa Student Loan Liquidity Corp. Rev., Taxable, "A", 5,08 %, 1/12/2039		415 000	401 769	0,09
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, Issue M, "A", 2,641 %, 1/07/2037		670 000	581 505	0,13
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, Issue M, "A", 4,949 %, 1/07/2038		1 030 000	950 402	0,22
Massachusetts Housing Finance Agency, Single Family Housing Rev., Taxable, "226", 5,562 %, 1/12/2052		585 000	588 931	0,13
Michigan Finance Authority Hospital Rev., Taxable (Trinity Health Credit Group), 3,384 %, 1/12/2040		470 000	383 329	0,09
Minnesota Housing Finance Agency, Residential Housing, Taxable, "G", 4,337 %, 1/01/2047		695 000	674 761	0,15
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), "C", 5,45 %, 15/08/2028		159 000	143 391	0,03
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), "C", AGM, 4,65 %, 15/08/2030		93 000	87 439	0,02
			3 811 527	0,86
Gaz naturel - Distribution				
Boston Gas Co., 3,15 %, 1/08/2027		278 000	259 667	0,06

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Gaz naturel - Distribution, suite				
ENGIE S.A., 4,5 %, 6/09/2042	EUR	200 000	229 167	0,05
ENGIE S.A., 4,25 %, 11/01/2043		600 000	666 811	0,15
			1 155 645	0,26
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 0,75 %, 15/03/2029		730 000	688 735	0,16
APA Infrastructure Ltd., 2,5 %, 15/03/2036	GBP	650 000	591 448	0,13
			1 280 183	0,29
Réseaux et télécommunications				
Orange S.A., 3,875 %, 11/09/2035	EUR	300 000	340 020	0,08
Services pétroliers				
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 5,25 %, 23/01/2084		400 000	439 041	0,10
Guara Norte S.à r.l., 5,198 %, 15/06/2034	USD	514 074	468 758	0,10
			907 799	0,20
Pétrole				
Neste Oyj, 3,875 %, 21/05/2031	EUR	130 000	144 780	0,03
Parkland Corp., 4,625 %, 1/05/2030	USD	1 107 000	1 019 901	0,23
			1 164 681	0,26
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
ABANCA Corp. Bancaria S.A., 5,875 % jusqu'au 2/04/2029, FLR jusqu'au 2/04/2030	EUR	600 000	693 758	0,16
AIB Group PLC, 6,608 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2029	USD	833 000	875 112	0,20
AIB Group PLC, 5,25 %, 23/10/2031	EUR	360 000	416 091	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 4,375 %, 11/01/2034		400 000	427 957	0,10
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 3,75 %, 3/02/2034		400 000	434 068	0,10
BBVA Bancomer S.A. (Texas), 8,125 %, 8/01/2039	USD	457 000	464 941	0,10
BPCE S.A., 4,5 %, 15/03/2025		428 000	421 253	0,10
BPCE S.A., 2,277 % jusqu'au 20/01/2031, FLR jusqu'au 20/01/2032		660 000	531 991	0,12
BPCE S.A., 4,75 % jusqu'au 14/06/2033, FLR jusqu'au 14/06/2034	EUR	200 000	229 729	0,05
BPCE S.A., 4,25 % jusqu'au 11/01/2034, FLR jusqu'au 11/01/2035		500 000	551 052	0,12
CaixaBank S.A., 5 % jusqu'au 19/07/2028, FLR jusqu'au 19/07/2029		300 000	339 131	0,08
CaixaBank S.A., 4,25 %, 6/09/2030		400 000	449 471	0,10
Deutsche Bank AG, 3,75 % jusqu'au 15/01/2029, FLR jusqu'au 15/01/2030		400 000	434 366	0,10
Deutsche Bank AG, 6,125 % jusqu'au 12/12/2029, FLR jusqu'au 12/12/2030	GBP	300 000	382 887	0,09
Deutsche Bank AG, 1,375 % jusqu'au 17/02/2031, FLR jusqu'au 17/02/2032	EUR	300 000	269 004	0,06
Deutsche Bank AG, 4 % jusqu'au 24/06/2027, FLR jusqu'au 24/06/2032		300 000	312 644	0,07
Intesa Sanpaolo S.p.A., 5,125 %, 29/08/2031		500 000	582 575	0,13
Intesa Sanpaolo S.p.A., 7,2 %, 28/11/2033	USD	533 000	571 020	0,13
KBC Group N.V., 4,75 %, 17/04/2035	EUR	500 000	543 938	0,12
M&T Bank Corp., 4,553 % jusqu'au 16/08/2027, FLR jusqu'au 16/08/2028	USD	461 000	445 023	0,10
Macquarie Group Ltd., 4,747 %, 23/01/2030	EUR	245 000	277 806	0,06
Macquarie Group Ltd., 6,255 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2034	USD	304 000	319 359	0,07
Shinhan Bank Co. Ltd., 4,375 %, 13/04/2032		621 000	571 965	0,13
Truist Financial Corp., 5,711 % jusqu'au 24/01/2034, FLR jusqu'au 24/01/2035		201 000	204 389	0,05
United Overseas Bank Ltd., 2 % jusqu'au 14/10/2026, FLR jusqu'au 14/10/2031		700 000	641 106	0,14
Uzbek Industrial and Construction Bank, 5,75 %, 2/12/2024		326 000	318 339	0,07
Virgin Money UK PLC, 7,625 %, 23/08/2029	GBP	350 000	473 513	0,11
			12 182 488	2,75
Produits pharmaceutiques				
Bayer US Finance LLC, 6,375 %, 21/11/2030	USD	690 000	704 329	0,16
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 4,75 %, 19/05/2033		474 000	473 412	0,11
Roche Holdings, Inc., 5,489 %, 13/11/2030		645 000	679 664	0,15
			1 857 405	0,42
Lutte contre la pollution				
Waste Management, Inc., 4,625 %, 15/02/2033		433 000	429 899	0,10
Métaux et minéraux précieux				
IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15/10/2028		602 000	529 760	0,12

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Métaux et minéraux précieux, suite				
Northern Star Resources Ltd. Co., 6,125 %, 11/04/2033	USD	375 000	382 207	0,09
			911 967	0,21
Immobilier - Bureaux				
Boston Properties LP, REIT, 3,65 %, 1/02/2026		349 000	337 050	0,08
Corporate Office Property LP, REIT, 2,25 %, 15/03/2026		556 000	522 342	0,12
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		234 000	196 602	0,04
Corporate Office Property LP, REIT, 2,75 %, 15/04/2031		341 000	278 390	0,06
			1 334 384	0,30
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		525 000	439 092	0,10
Extra Space Storage LP, 5,5 %, 1/07/2030		569 000	581 888	0,13
Lexington Realty Trust Co., REIT, 2,7 %, 15/09/2030		427 000	359 231	0,08
			1 380 211	0,31
Immobilier - Distribution				
STORE Capital Corp., REIT, 2,75 %, 18/11/2030		529 000	420 465	0,09
STORE Capital Corp., REIT, 2,7 %, 1/12/2031		156 000	122 248	0,03
WEA Finance LLC, 2,875 %, 15/01/2027		489 000	442 235	0,10
			984 948	0,22
Restaurants				
McDonald's Corp., 3,875 %, 20/02/2031	EUR	320 000	358 220	0,08
Distribution				
AutoZone, Inc., 4,75 %, 1/08/2032	USD	309 000	303 654	0,07
Home Depot, Inc., 3,625 %, 15/04/2052		447 000	353 585	0,08
			657 239	0,15
Produits chimiques spéciaux				
Covestro AG, 1,375 %, 12/06/2030	EUR	420 000	402 695	0,09
CTEC II GmbH, 5,25 %, 15/02/2030		545 000	527 464	0,12
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027	USD	310 000	274 678	0,06
International Flavors & Fragrances, Inc., 4,375 %, 1/06/2047		306 000	237 771	0,06
			1 442 608	0,33
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		342 000	290 790	0,07
Dufry One B.V., 3,375 %, 15/04/2028	EUR	480 000	496 041	0,11
Michael Cos., Inc., 7,875 %, 1/05/2029	USD	607 000	388 233	0,09
			1 175 064	0,27
Hypermarchés				
Ocado Group PLC, 3,875 %, 8/10/2026	GBP	740 000	812 371	0,18
Picard Bondco S.A., 5,375 %, 1/07/2027	EUR	480 000	492 747	0,11
			1 305 118	0,29
Organismes supranationaux				
European Financial Stability Facility, 3 %, 4/09/2034		2 222 000	2 440 702	0,55
Banque européenne d'investissement, 3 %, 15/02/2039		2 400 000	2 590 444	0,58
European Union, 3,125 %, 5/12/2028		2 650 000	2 938 665	0,66
European Union, 3,25 %, 4/07/2034		2 032 000	2 281 661	0,52
European Union, 2,625 %, 4/02/2048		2 585 000	2 539 241	0,57
European Union, 3 %, 4/03/2053		2 650 000	2 728 447	0,62
			15 519 160	3,50
Télécommunications mobiles				
Millicom International Cellular S.A., 5,125 %, 15/01/2028	USD	365 400	342 263	0,08
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032		472 000	429 326	0,10
T-Mobile USA, Inc., 3,875 %, 15/04/2030		442 000	418 000	0,09
T-Mobile USA, Inc., 5,75 %, 15/01/2034		304 000	320 282	0,07
Vodafone Group PLC, 3,375 %, 8/08/2049	GBP	350 000	303 605	0,07
Vodafone Group PLC, 5,625 %, 10/02/2053	USD	369 000	371 734	0,08
			2 185 210	0,49

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services téléphoniques				
Deutsche Telekom AG, 1,375 %, 5/07/2034	EUR	520 000	483 596	0,11
TELUS Corp., 2,85 %, 13/11/2031	CAD	1 010 000	654 545	0,15
			1 138 141	0,26
Tabac				
B.A.T. International Finance PLC, 2,25 %, 16/01/2030	EUR	460 000	446 724	0,10
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 17/11/2027	USD	314 000	319 139	0,07
			765 863	0,17
Transports - Services				
Aeroporti di Roma S.p.A., 4,875 %, 10/07/2033	EUR	510 000	579 609	0,13
Autostrade per l'Italia S.p.A., 5,125 %, 14/06/2033		180 000	204 283	0,05
Autostrade per l'Italia S.p.A., 4,75 %, 24/01/2031		330 000	369 312	0,08
Element Fleet Management Corp., 6,271 %, 26/06/2026	USD	291 000	296 260	0,07
Element Fleet Management Corp., 6,319 %, 4/12/2028		599 000	622 472	0,14
Transurban Finance Co. Pty Ltd., 4,225 %, 26/04/2033	EUR	470 000	532 279	0,12
Triton International Ltd., 3,15 %, 15/06/2031	USD	496 000	398 478	0,09
United Parcel Service, 5,05 %, 3/03/2053		603 000	610 086	0,14
			3 612 779	0,82
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 3,875 %, 15/05/2043		4 022 000	3 784 450	0,86
Obligations du Trésor américain, 4,375 %, 15/08/2043		692 000	696 974	0,16
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/11/2049		886 000	618 539	0,14
Obligations du Trésor américain, 3,625 %, 15/05/2053		711 000	638 900	0,14
Bons du Trésor américain, 3,75 %, 31/12/2028		5 891 000	5 857 403	1,32
Bons du Trésor américain, 4,875 %, 31/10/2030 (g)		11 302 000	11 930 674	2,69
			23 526 940	5,31
Services publics - Énergie électrique				
Adani Transmission Ltd., 4,25 %, 21/05/2036		549 500	458 927	0,10
Adani Transmission Ltd., 4,25 %, 21/05/2036		235 500	196 683	0,04
American Electric Power Co., Inc., 5,699 %, 15/08/2025		105 000	105 808	0,02
American Electric Power Co., Inc., 5,625 %, 1/03/2033		196 000	202 208	0,05
American Transmission Systems, Inc., 2,65 %, 15/01/2032		374 000	314 405	0,07
Berkshire Hathaway Energy Co., 5,15 %, 15/11/2043		99 000	98 113	0,02
Berkshire Hathaway Energy Co., 4,6 %, 1/05/2053		82 000	72 435	0,02
Bruce Power LP, 2,68 %, 21/12/2028	CAD	825 000	562 880	0,13
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/02/2031	USD	1 320 000	1 144 218	0,26
ContourGlobal Power Holdings S.A., 2,75 %, 1/01/2026	EUR	935 000	966 247	0,22
Duke Energy Florida LLC, 6,2 %, 15/11/2053	USD	278 000	311 098	0,07
E.ON International Finance B.V., 5,875 %, 30/10/2037	GBP	500 000	658 119	0,15
EDP Servicios Financieros Espana S.A., 4,375 %, 4/04/2032	EUR	237 000	272 751	0,06
Enel Finance International N.V., 3,5 %, 6/04/2028	USD	200 000	188 519	0,04
Enel Finance International N.V., 2,25 %, 12/07/2031		629 000	512 958	0,12
Enel Finance International N.V., 3,875 %, 23/01/2035	EUR	450 000	492 345	0,11
ENGIE Energía Chile S.A., 3,4 %, 28/01/2030	USD	630 000	551 252	0,12
EPH Financing International A.S., 6,651 %, 13/11/2028	EUR	554 000	611 769	0,14
Eversource Energy, 5,5 %, 1/01/2034	USD	300 000	303 438	0,07
Florida Power & Light Co., 2,875 %, 4/12/2051		357 000	241 805	0,06
Georgia Power Co., 4,95 %, 17/05/2033		611 000	611 199	0,14
Investment Energy Resources Ltd., 6,25 %, 26/04/2029		200 000	190 194	0,04
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		351 000	295 838	0,07
Listrindo Capital B.V., 4,95 %, 14/09/2026		276 000	267 030	0,06
Mong Duong Finance Holdings B.V., 5,125 %, 7/05/2029		363 382	340 595	0,08
National Grid Electricity Transmission PLC, 2 %, 17/04/2040	GBP	330 000	263 990	0,06
National Grid PLC, 4,275 %, 16/01/2035	EUR	490 000	543 116	0,12
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 6,051 %, 1/03/2025	USD	147 000	148 239	0,03
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 5,749 %, 1/09/2025		227 000	229 292	0,05

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Opportunistic Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services publics - Énergie électrique, suite				
Pacific Gas & Electric Co., 6,1 %, 15/01/2029	USD	271 000	280 769	0,06
Pacific Gas & Electric Co., 6,4 %, 15/06/2033		211 000	223 988	0,05
PPL Electric Utilities Corp, 1st Mortgage, 5,25 %, 15/05/2053		501 000	504 783	0,11
SSE PLC, 4 %, 5/09/2031	EUR	355 000	398 818	0,09
Star Energy Geothermal (Wayang Windu) Ltd., 6,75 %, 24/04/2033	USD	405 400	404 256	0,09
WEC Energy Group, Inc., 1,8 %, 15/10/2030		472 000	386 342	0,09
Xcel Energy, Inc., 4,6 %, 1/06/2032		266 000	258 060	0,06
			13 612 487	3,07
Services publics - Gaz				
EP Infrastructure A.S., 2,045 %, 9/10/2028	EUR	1 297 000	1 192 862	0,27
Total des obligations (coût identifié, 429 792 888 \$)			421 286 374	95,15
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 1 228 000 \$)	USD	1 228 000	1 227 823	0,28
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 431 020 888 \$)			422 514 197	95,43

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS D'ACHAT ACHETÉES				
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3,5 %	44 183 116	EUR 37 760 000	457 106	0,10
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3,5 %	22 267 073	19 030 000	230 369	0,05
iTraxx Europe Crossover Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 3 %	92 356 285	78 930 000	211 781	0,05
Total des Options d'Achat Achetées (primes versées, 633 242 \$)			899 256	0,20
Total des investissements (coût identifié, 431 654 130 \$) (k)			423 413 453	95,63
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			19 350 562	4,37
ACTIF NET			442 764 015	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Global Research Focused Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES				
Aérospatiale et défense				
Honeywell International, Inc.		17 812	3 602 655	2,77
Boissons alcoolisées				
Diageo PLC		27 765	998 618	0,77
Industrie de la confection				
Compagnie Financière Richemont S.A.		8 337	1 246 275	0,96
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE		4 308	3 582 967	2,75
NIKE, Inc., "B"		8 013	813 560	0,63
			5 642 802	4,34
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Charles Schwab Corp.		36 422	2 291 672	1,76
Euronext N.V.		27 972	2 462 897	1,90
			4 754 569	3,66
Services aux entreprises				
Accenture PLC, "A"		8 038	2 924 867	2,25

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Research Focused Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels			
Cadence Design Systems, Inc.	5 283	1 523 934	1,17
Microsoft Corp.	25 598	10 177 253	7,83
Salesforce, Inc.	10 705	3 009 068	2,31
		14 710 255	11,31
Logiciels - Systèmes			
Hitachi Ltd.	46 200	3 629 037	2,79
ServiceNow, Inc.	2 125	1 626 475	1,25
		5 255 512	4,04
Équipements électriques			
Johnson Controls International PLC	24 132	1 271 515	0,98
Schneider Electric SE	17 826	3 513 284	2,70
		4 784 799	3,68
Électronique			
Marvell Technology, Inc.	27 050	1 831 285	1,41
NXP Semiconductors N.V.	13 826	2 911 341	2,24
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	26 358	2 977 400	2,29
		7 720 026	5,94
Énergie - Sociétés indépendantes			
ConocoPhillips	16 130	1 804 463	1,39
Woodside Energy Group Ltd.	39 698	832 039	0,64
		2 636 502	2,03
Énergie - Sociétés intégrées			
TotalEnergies SE	34 255	2 230 961	1,72
Alimentation et boissons			
Mondelez International, Inc.	50 364	3 790 898	2,92
Nestlé S.A.	19 977	2 277 750	1,75
		6 068 648	4,67
Assurances			
AIA Group Ltd.	193 000	1 500 682	1,15
Aon PLC	9 016	2 690 645	2,07
Chubb Ltd.	9 509	2 329 705	1,79
		6 521 032	5,01
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	30 866	4 324 327	3,32
Gartner, Inc.	2 804	1 282 662	0,99
Meta Platforms, Inc., "A"	7 466	2 912 785	2,24
		8 519 774	6,55
Loisirs et jouets			
Electronic Arts, Inc.	9 598	1 320 493	1,01
Machines et outils			
Ingersoll Rand, Inc.	31 347	2 503 371	1,93
SMC Corp.	4 100	2 281 656	1,75
		4 785 027	3,68
Grandes banques			
Goldman Sachs Group, Inc.	7 817	3 001 806	2,31
NatWest Group PLC	904 103	2 563 863	1,97
		5 565 669	4,28
Équipements médicaux			
Agilent Technologies, Inc.	19 005	2 472 550	1,90
Becton, Dickinson and Co.	10 555	2 520 640	1,94
Medtronic PLC	32 879	2 878 228	2,21
		7 871 418	6,05
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Visa, Inc., "A"	13 364	3 651 847	2,81

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Research Focused Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Produits pharmaceutiques			
Roche Holding AG	12 295	3 512 899	2,70
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	5 971	2 587 712	1,99
		6 100 611	4,69
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	28 035	2 255 976	1,73
Immobilier			
LEG Immobilien SE	10 130	845 940	0,65
Produits chimiques spéciaux			
Croda International PLC	13 199	803 737	0,62
DuPont de Nemours, Inc.	21 955	1 356 819	1,04
Linde PLC	9 720	3 934 948	3,03
		6 095 504	4,69
Magasins spécialisés			
Amazon.com, Inc.	30 070	4 666 864	3,59
Home Depot, Inc.	5 948	2 099 406	1,61
		6 766 270	5,20
Télécommunications mobiles			
Cellnex Telecom S.A.	36 186	1 393 364	1,07
KDDI Corp.	39 900	1 320 269	1,02
		2 713 633	2,09
Services publics - Énergie électrique			
Iberdrola S.A.	211 518	2 548 428	1,96
PG&E Corp.	101 952	1 719 930	1,32
		4 268 358	3,28
Total des actions ordinaires (coût identifié, 100 573 225 \$)		128 611 766	98,90
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)			
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 143 000 \$)	USD 143 000	142 979	0,11
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 100 716 225 \$) (k)		128 754 745	99,01
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		1 290 784	0,99
ACTIF NET		130 045 529	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Global Strategic Equity Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Safran S.A.	272	50 935	1,52
Industrie de la confection			
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	98	81 507	2,43
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
CME Group, Inc.	327	67 310	2,01
Services aux entreprises			
CoStar Group, Inc.	1 023	85 400	2,55
MSCI, Inc.	185	110 745	3,30
Nomura Research Institute Ltd.	2 300	70 244	2,09
		266 389	7,94
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	138	85 253	2,54
Cadence Design Systems, Inc.	324	93 461	2,79

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Strategic Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels, suite			
Intuit, Inc.	112	70 709	2,11
Microsoft Corp.	746	296 595	8,84
Synopsys, Inc.	163	86 936	2,59
		632 954	18,87
Construction			
Vulcan Materials Co.	346	78 199	2,33
Biens de consommation			
Estée Lauder Cos., Inc., "A"	278	36 693	1,09
Équipements électriques			
Schneider Electric SE	509	100 318	2,99
Électronique			
ASML Holding N.V.	140	119 987	3,57
NVIDIA Corp.	357	219 651	6,55
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	929	104 940	3,13
		444 578	13,25
Alimentation et boissons			
Nestlé S.A.	326	37 170	1,11
Assurances			
Arthur J. Gallagher & Co.	302	70 112	2,09
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	1 445	202 444	6,03
Meta Platforms, Inc., "A"	470	183 366	5,47
Tencent Holdings Ltd.	400	13 912	0,41
		399 722	11,91
Machines et outils			
Daikin Industries Ltd.	300	48 221	1,44
Eaton Corp. PLC	391	96 217	2,87
		144 438	4,31
Technologies et services médicaux et de santé			
Veeva Systems, Inc.	209	43 349	1,29
Équipements médicaux			
Boston Scientific Corp.	1 532	96 915	2,89
Thermo Fisher Scientific, Inc.	141	75 996	2,26
		172 911	5,15
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Mastercard, Inc., "A"	293	131 624	3,92
Produits pharmaceutiques			
Argenx SE, ADR	35	13 318	0,40
Novo Nordisk A.S., "B"	1 266	144 590	4,31
		157 908	4,71
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	697	102 818	3,06
Produits chimiques spéciaux			
Linde PLC	287	116 186	3,46
Magasins spécialisés			
Amazon.com, Inc.	1 230	190 896	5,69
PDD Holdings, Inc., ADR	108	13 702	0,41
		204 598	6,10
Total des actions ordinaires (coût identifié, 2 593 415 \$)		3 339 719	99,54
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 593 415 \$) (k)		3 339 719	99,54
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		15 266	0,46
ACTIF NET		3 354 985	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
General Dynamics Corp.	37 595	9 962 299	0,67
Honeywell International, Inc.	19 846	4 014 052	0,27
L3Harris Technologies, Inc.	18 804	3 919 130	0,26
		17 895 481	1,20
Boissons alcoolisées			
Ambev S.A.	334 300	882 578	0,06
Diageo PLC	201 969	7 264 180	0,49
Heineken N.V.	44 967	4 525 663	0,30
Kirin Holdings Co. Ltd.	211 900	3 062 646	0,20
Pernod Ricard S.A.	18 732	3 082 959	0,21
		18 818 026	1,26
Industrie de la confection			
Compagnie Financiere Richemont S.A.	35 884	5 364 200	0,36
Industrie automobile			
Aptiv PLC	68 266	5 552 074	0,37
Bridgestone Corp.	55 400	2 408 242	0,16
Lear Corp.	27 384	3 639 334	0,24
LKQ Corp.	129 733	6 054 639	0,41
Stellantis N.V.	104 064	2 292 372	0,15
Tofas Turk Otomobil Fabrikasi A.S.	81 811	664 301	0,05
		20 610 962	1,38
Biotechnologies			
Biogen, Inc.	2 845	701 748	0,05
Radio-télévision			
Omnicom Group, Inc.	137 854	12 459 244	0,83
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Bank of New York Mellon Corp.	109 650	6 081 189	0,41
Cboe Global Markets, Inc.	22 019	4 048 193	0,27
Charles Schwab Corp.	203 695	12 816 489	0,86
CME Group, Inc.	13 908	2 862 823	0,19
		25 808 694	1,73
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	16 498	6 003 292	0,40
CGI, Inc.	27 540	3 084 103	0,21
Experian PLC	78 753	3 283 280	0,22
Fidelity National Information Services, Inc.	48 982	3 049 619	0,20
Fiserv, Inc.	42 399	6 015 146	0,40
SCSK Corp.	42 500	835 713	0,06
Secom Co. Ltd.	86 500	6 268 030	0,42
TriNet Group, Inc.	9 287	1 055 932	0,07
Verisk Analytics, Inc., "A"	5 255	1 269 240	0,08
		30 864 355	2,06
Télévision par câble			
Comcast Corp., "A"	441 032	20 525 629	1,37
Produits chimiques			
Nutrien Ltd.	9 680	482 686	0,03
PPG Industries, Inc.	47 539	6 704 901	0,45
		7 187 587	0,48
Logiciels			
Dun & Bradstreet Holdings, Inc.	436 024	5 053 518	0,34
Microsoft Corp.	29 083	11 562 819	0,77
		16 616 337	1,11
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	41 595	2 907 623	0,19
Cap Gemini S.A.	32 724	7 327 594	0,49

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels - Systèmes, suite			
Fujitsu Ltd.	40 400	5 704 714	0,38
Hitachi Ltd.	108 900	8 554 159	0,57
Hon Hai Precision Industry Co. Ltd.	1 625 000	5 300 375	0,36
Lenovo Group Ltd.	1 758 000	1 819 043	0,12
Samsung Electronics Co. Ltd.	165 789	8 989 863	0,60
Seagate Technology Holdings PLC	9 578	820 643	0,06
		41 424 014	2,77
Construction			
Anhui Conch Cement Co. Ltd.	779 500	1 563 397	0,10
Compagnie de Saint-Gobain S.A.	45 569	3 226 942	0,22
Heidelberg Materials AG	37 198	3 452 366	0,23
Masco Corp.	128 942	8 676 507	0,58
Stanley Black & Decker, Inc.	41 140	3 838 362	0,26
Techtronic Industries Co. Ltd.	217 500	2 323 559	0,15
Zhejiang Supor Co. Ltd., "A"	106 700	752 743	0,05
		23 833 876	1,59
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	68 489	5 766 774	0,39
Kenvue, Inc.	224 364	4 657 797	0,31
Kimberly-Clark Corp.	71 118	8 603 144	0,57
Procter & Gamble Co.	4 495	706 344	0,05
Reckitt Benckiser Group PLC	72 533	5 237 768	0,35
		24 971 827	1,67
Équipements électriques			
Johnson Controls International PLC	185 884	9 794 228	0,66
Legrand S.A.	37 631	3 659 223	0,24
Mitsubishi Electric Corp.	283 500	4 175 000	0,28
Schneider Electric SE	57 930	11 417 287	0,76
		29 045 738	1,94
Électronique			
Analog Devices, Inc.	7 373	1 418 270	0,09
Broadcom, Inc.	1 581	1 865 580	0,12
Intel Corp.	158 230	6 816 549	0,46
Kyocera Corp.	420 700	6 164 935	0,41
Lam Research Corp.	4 489	3 704 188	0,25
Novatek Microelectronics Corp.	108 000	1 753 317	0,12
NVIDIA Corp.	3 003	1 847 656	0,12
NXP Semiconductors N.V.	40 286	8 483 023	0,57
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	48 481	5 476 414	0,37
		37 529 932	2,51
Énergie - Sociétés indépendantes			
ConocoPhillips	95 040	10 632 125	0,71
Hess Corp.	52 884	7 431 788	0,50
Phillips 66	64 482	9 305 397	0,62
Pioneer Natural Resources Co.	10 695	2 458 032	0,17
Valero Energy Corp.	26 241	3 644 875	0,24
		33 472 217	2,24
Énergie - Sociétés intégrées			
Aker BP ASA	48 372	1 282 826	0,09
Eni S.p.A.	751 295	12 016 582	0,80
Exxon Mobil Corp.	13 469	1 384 748	0,09
LUKOIL PJSC (c)	8 747	0	0,00
PetroChina Co. Ltd.	6 470 000	4 634 601	0,31
Petroleo Brasileiro S.A., ADR	115 135	1 888 214	0,13
Suncor Energy, Inc.	252 683	8 367 323	0,56

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Énergie - Sociétés intégrées, suite			
TotalEnergies SE	112 636	7 335 762	0,49
		36 910 056	2,47
Ingénierie - Construction			
ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.	23 278	918 947	0,06
Doosan Bobcat, Inc.	44 831	1 686 175	0,11
		2 605 122	0,17
Alimentation et boissons			
Archer Daniels Midland Co.	30 092	1 672 513	0,11
Danone S.A.	71 597	4 777 126	0,32
General Mills, Inc.	109 968	7 138 023	0,48
J.M. Smucker Co.	15 181	1 997 061	0,13
WH Group Ltd.	888 500	522 784	0,04
		16 107 507	1,08
Magasins d'alimentation et pharmacies			
BIM Birlesik Magazalar A.S.	134 797	1 692 459	0,12
Tesco PLC	3 185 164	11 556 144	0,77
Wesfarmers Ltd.	28 064	1 067 744	0,07
		14 316 347	0,96
Produits forestiers et papier			
Weyerhaeuser Co., REIT	37 551	1 230 546	0,08
Jeux et hôtellerie			
Aristocrat Leisure Ltd.	30 035	865 657	0,06
Organisations de soins de santé intégrés			
Cigna Group	53 243	16 023 481	1,07
Assurances			
Aon PLC	36 998	11 041 313	0,74
China Pacific Insurance Co. Ltd.	275 200	504 079	0,03
Chubb Ltd.	35 925	8 801 625	0,59
DB Insurance Co. Ltd.	12 362	808 855	0,05
Equitable Holdings, Inc.	179 269	5 860 304	0,39
Hartford Financial Services Group, Inc.	25 124	2 184 783	0,15
Manulife Financial Corp.	383 059	8 467 785	0,57
MetLife, Inc.	51 528	3 571 921	0,24
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	18 567	3 661 574	0,24
Travelers Cos., Inc.	5 520	1 166 707	0,08
Willis Towers Watson PLC	29 744	7 325 947	0,49
		53 394 893	3,57
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	55 492	7 774 429	0,52
Machines et outils			
Eaton Corp. PLC	35 738	8 794 407	0,59
Ingersoll Rand, Inc.	60 159	4 804 298	0,32
Kubota Corp.	239 800	3 641 117	0,25
Regal Rexnord Corp.	39 027	5 208 543	0,35
Timken Co.	9 267	759 060	0,05
Volvo Group	158 713	3 790 204	0,25
		26 997 629	1,81
Grandes banques			
ABN AMRO Group N.V., GDR	370 924	5 485 265	0,37
Bank of America Corp.	332 234	11 299 278	0,75
BNP Paribas	217 403	14 618 355	0,98
DBS Group Holdings Ltd.	303 400	7 183 873	0,48
Erste Group Bank AG	29 753	1 287 771	0,09
Goldman Sachs Group, Inc.	34 705	13 327 067	0,89
JPMorgan Chase & Co.	73 093	12 744 495	0,85

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Grandes banques, suite			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	1 020 300	9 566 619	0,64
NatWest Group PLC	3 122 091	8 853 652	0,59
UBS Group AG	559 539	16 711 572	1,12
		101 077 947	6,76
Technologies et services médicaux et de santé			
ICON PLC	12 739	3 323 223	0,22
McKesson Corp.	10 162	5 079 882	0,34
		8 403 105	0,56
Équipements médicaux			
Becton, Dickinson and Co.	23 469	5 604 632	0,37
Boston Scientific Corp.	40 039	2 532 867	0,17
Medtronic PLC	81 619	7 144 927	0,48
		15 282 426	1,02
Métaux et exploitation minière			
Fortescue Ltd.	48 101	934 581	0,06
Glencore PLC	1 204 542	6 418 238	0,43
Rio Tinto PLC	149 354	10 415 878	0,70
Toyota Tsusho Corp.	21 200	1 387 685	0,09
Vale S.A.	136 800	1 870 977	0,13
		21 027 359	1,41
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
China Construction Bank Corp.	2 401 000	1 423 113	0,10
Julius Baer Group Ltd.	69 377	3 788 803	0,25
KB Financial Group, Inc.	19 701	835 482	0,06
M&T Bank Corp.	11 241	1 552 382	0,10
Northern Trust Corp.	86 695	6 904 390	0,46
Sberbank of Russia PJSC (c)	849 440	0	0,00
Truist Financial Corp.	154 014	5 707 759	0,38
		20 211 929	1,35
Produits pharmaceutiques			
AbbVie, Inc.	54 538	8 966 047	0,60
Bayer AG	90 198	2 807 820	0,19
Johnson & Johnson	99 920	15 877 288	1,06
Merck & Co., Inc.	10 865	1 312 275	0,09
Novartis AG	42 048	4 356 094	0,29
Organon & Co.	296 404	4 935 126	0,33
Pfizer, Inc.	323 361	8 756 616	0,58
Roche Holding AG	65 480	18 708 795	1,25
Sanofi	50 497	5 070 484	0,34
		70 790 545	4,73
Imprimerie et édition			
RELX PLC	97 639	4 032 917	0,27
Wolters Kluwer N.V.	27 895	4 114 947	0,27
		8 147 864	0,54
Chemins de fer et transport maritime			
Union Pacific Corp.	29 786	7 265 699	0,49
Immobilier			
Brixmor Property Group, Inc., REIT	56 944	1 277 823	0,09
Broadstone Net Lease, Inc., REIT	26 949	433 071	0,03
NNN REIT, Inc.	31 064	1 253 122	0,08
		2 964 016	0,20
Restaurants			
Sodexo	43 030	4 864 164	0,33
Texas Roadhouse, Inc.	7 765	976 216	0,06
		5 840 380	0,39

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Produits chimiques spéciaux				
Akzo Nobel N.V.		43 933	3 362 449	0,23
Axalta Coating Systems Ltd.		100 046	3 243 491	0,22
Chemours Co.		26 592	802 281	0,05
Nitto Denko Corp.		19 900	1 647 877	0,11
			9 056 098	0,61
Magasins spécialisés				
Home Depot, Inc.		7 818	2 759 442	0,18
Ross Stores, Inc.		11 165	1 566 226	0,11
Target Corp.		27 803	3 866 841	0,26
			8 192 509	0,55
Télécommunications mobiles				
KDDI Corp.		340 800	11 276 886	0,76
T-Mobile USA, Inc.		49 435	7 970 405	0,53
			19 247 291	1,29
Services téléphoniques				
Hellenic Telecommunications Organization S.A.		139 212	1 933 237	0,13
Quebecor, Inc., "B"		92 761	2 255 463	0,15
			4 188 700	0,28
Tabac				
British American Tobacco PLC		234 378	6 921 026	0,46
Japan Tobacco, Inc.		172 100	4 536 466	0,31
Philip Morris International, Inc.		61 217	5 561 564	0,37
			17 019 056	1,14
Services publics - Énergie électrique				
Duke Energy Corp.		42 036	4 028 310	0,27
E.ON SE		444 420	6 032 377	0,40
Edison International		81 673	5 511 294	0,37
Iberdrola S.A.		499 748	6 021 101	0,40
National Grid PLC		464 509	6 183 136	0,41
PG&E Corp.		400 354	6 753 972	0,45
Vistra Corp.		30 963	1 270 412	0,09
			35 800 602	2,39
Total des actions ordinaires (coût identifié, 767 383 255 \$)			897 871 060	60,05
OBLIGATIONS				
Aérospatiale et défense				
HEICO Corp., 5,35 %, 1/08/2033	USD	1 255 000	1 275 422	0,09
Thales S.A., 3,625 %, 14/06/2029	EUR	600 000	662 864	0,04
Thales S.A., 4,25 %, 18/10/2031		600 000	686 586	0,05
			2 624 872	0,18
Industrie de la confection				
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,5 %, 7/09/2033		300 000	335 183	0,02
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032	USD	543 000	434 286	0,03
			769 469	0,05
Créances adossées à des actifs et titrisées				
ACREC 2021-FL1 Ltd., "C", FLR, 7,599 %, 16/10/2036		1 202 000	1 159 078	0,08
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "B", FLR, 6,947 %, 15/12/2035		453 500	441 487	0,03
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL2, "B", FLR, 7,047 %, 15/05/2036		309 000	304 415	0,02
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL2, "C", FLR, 7,398 %, 15/05/2036		918 000	882 893	0,06
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "B", FLR, 7,446 %, 15/01/2037		1 866 000	1 820 947	0,12
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "C", FLR, 7,646 %, 15/01/2037		1 797 000	1 733 090	0,12
AREIT 2022-CRE6 Trust, "B", FLR, 7,195 %, 20/01/2037		673 500	653 528	0,04
AREIT 2022-CRE6 Trust, "C", FLR, 7,495 %, 20/01/2037		338 500	323 026	0,02
Brazos Securitization LLC, 5,413 %, 1/09/2050		590 000	628 224	0,04
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "B", FLR, 7,498 %, 15/12/2038		417 000	408 425	0,03

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "C", FLR, 7,747 %, 15/12/2038	USD	377 500	368 219	0,02
Business Jet Securities LLC, 2020-1A, "A", 2,981 %, 15/11/2035		135 848	131 687	0,01
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "A", 2,162 %, 15/04/2036		249 367	233 279	0,02
BXMT 2021-FL4 Ltd., "AS", FLR, 6,746 %, 15/05/2038		1 500 000	1 396 111	0,09
BXMT 2021-FL4 Ltd., "B", FLR, 6,996 %, 15/05/2038		2 196 000	2 016 453	0,14
Capital Automotive, 2020-1A, "A4", REIT, 3,19 %, 15/02/2050		660 947	636 847	0,04
Colt Funding LLC, 2024-1, "A1", 5,835 %, 25/02/2069		1 129 334	1 129 320	0,08
Consumers 2023 Securitization Funding LLC, 5,55 %, 1/03/2028		934 000	937 753	0,06
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-3A, "A", 1 %, 15/05/2030		623 198	616 341	0,04
Empire District Bondco LLC, 4,943 %, 1/01/2033		1 135 000	1 137 141	0,08
Fortress CBO Investments Ltd., 2022-FL3, "AS", FLR, 7,595 %, 23/02/2039		644 000	625 414	0,04
FS Rialto 2021-FL2 Issuer Ltd., "AS", FLR, 6,997 %, 16/05/2038		1 549 000	1 497 792	0,10
Hartwick Park CLO Ltd., 2023-1A, "A", FLR, 6,97 %, 21/01/2036		1 467 000	1 466 764	0,10
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "B", FLR, 7,448 %, 15/07/2036		845 500	816 587	0,05
MF1 2021-FL5 Ltd., "AS", FLR, 6,646 %, 15/07/2036		1 446 000	1 415 890	0,10
MF1 2021-FL5 Ltd., "C", FLR, 7,146 %, 15/07/2036		275 000	264 165	0,02
MF1 2021-FL6 Ltd., "AS", FLR, 6,899 %, 16/07/2036		2 500 000	2 451 556	0,16
MF1 2021-FL6 Ltd., "B", FLR, 7,099 %, 16/07/2036		2 350 000	2 283 465	0,15
MF1 2022-FL8 Ltd., "B", FLR, 7,287 %, 19/02/2037		657 355	642 669	0,04
MF1 2024-FL14 Ltd., "A", FLR, 7,055 %, 19/03/2039		1 804 000	1 799 490	0,12
Neuberger Berman CLO Ltd., 2023-53A, "B", FLR, 7,589 %, 24/10/2032		1 178 010	1 179 924	0,08
OBX Trust, 2024-NQM1, "A1", 5,928 %, 25/11/2063		774 039	778 174	0,05
OBX Trust, 2024-NQM2, "A1", 5,878 %, 25/12/2063		1 890 337	1 893 762	0,13
Onslow Bay Financial LLC OBX Trust, 2024-NQM1, "A", 5,928 %, 25/11/2063		205 526	206 624	0,01
RAC Bond Co. PLC, 4,87 %, 6/05/2026	GBP	610 000	753 838	0,05
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "A", FLR, 6,649 %, 18/04/2038	USD	1 489 991	1 465 475	0,10
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "AS", FLR, 6,899 %, 18/04/2038		1 509 000	1 443 108	0,10
TPG Real Estate Finance, 2021-FL4, "AS", FLR, 6,846 %, 15/03/2038		720 000	700 227	0,05
Verus Securitization Trust, 2014-1, "A1", 5,712 %, 25/01/2069		1 266 332	1 265 408	0,08
Westlake Automobile Receivables Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 6,196 %, 15/06/2026		189 446	189 591	0,01
			40 098 187	2,68
Industrie automobile				
Hyundai Capital America, 6,375 %, 8/04/2030		667 000	710 124	0,05
LKQ Corp., 6,25 %, 15/06/2033		433 000	451 795	0,03
Mercedes-Benz Finance Co. Ltd., 3,25 %, 10/01/2032	EUR	590 000	639 937	0,04
Volkswagen International Finance N.V., 7,5 %, 6/09/2172		400 000	468 989	0,03
Volkswagen International Finance N.V., 7,875 %, 6/09/2172		100 000	121 664	0,01
Volkswagen Leasing GmbH, 4 %, 11/04/2031		320 000	350 343	0,02
			2 742 852	0,18
Radio-télévision				
Discovery Communications LLC, 4,125 %, 15/05/2029	USD	1 019 000	967 075	0,06
Prosus N.V., 3,68 %, 21/01/2030		657 000	572 264	0,04
Ubisoft Entertainment S.A., 0,878 %, 24/11/2027	EUR	2 500 000	2 232 321	0,15
Walt Disney Co., 3,5 %, 13/05/2040	USD	719 000	596 731	0,04
WarnerMedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032		1 012 000	926 598	0,06
			5 294 989	0,35
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Charles Schwab Corp., 5,643 % jusqu'au 19/05/2028, FLR jusqu'au 19/05/2029		390 000	399 030	0,03
Charles Schwab Corp., 6,136 % jusqu'au 24/08/2033, FLR jusqu'au 24/08/2034		382 000	403 720	0,03
Low Income Investment Fund, 3,386 %, 1/07/2026		360 000	339 219	0,02
Low Income Investment Fund, 3,711 %, 1/07/2029		980 000	859 287	0,06
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		1 372 000	1 264 461	0,08
LSEG Netherlands B.V., 4,231 %, 29/09/2030	EUR	610 000	694 293	0,04
			3 960 010	0,26

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Construction				
HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A., 4,875 %, 21/11/2033	EUR	420 000	488 726	0,03
Holcim Sterling Finance (Netherlands) B.V., 2,25 %, 4/04/2034	GBP	800 000	774 136	0,05
Imerys S.A., 4,75 %, 29/11/2029	EUR	700 000	779 373	0,05
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030	USD	425 000	394 445	0,03
			2 436 680	0,16
Services aux entreprises				
Corning, Inc., 4,125 %, 15/05/2031	EUR	550 000	618 719	0,04
Euronet Worldwide, Inc., 1,375 %, 22/05/2026		655 000	666 516	0,04
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049	USD	704 000	613 091	0,04
Mastercard, Inc., 3,85 %, 26/03/2050		449 000	383 918	0,03
			2 282 244	0,15
Télévision par câble				
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 6,384 %, 23/10/2035		189 000	190 561	0,01
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 4,8 %, 1/03/2050		506 000	386 284	0,03
Cox Communications, Inc., 5,45 %, 15/09/2028		755 000	770 464	0,05
SES S.A., 3,5 %, 14/01/2029	EUR	650 000	688 780	0,05
			2 036 089	0,14
Produits chimiques				
Arkema S.A., 4,25 %, 20/05/2030		500 000	564 099	0,04
Arkema S.A., 1,5 % jusqu'au 21/01/2026, FLR jusqu'au 21/01/2171		400 000	405 272	0,02
			969 371	0,06
Logiciels				
Microsoft Corp., 2,921 %, 17/03/2052	USD	917 000	658 210	0,04
Oracle Corp., 4 %, 15/07/2046		551 000	444 557	0,03
			1 102 767	0,07
Conglomérats				
nVent Finance S.à r.l., 5,65 %, 15/05/2033		916 000	940 165	0,06
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		1 179 000	1 196 270	0,08
Siemens Financieringsmaatschappij N.V., 3,625 %, 24/02/2043	EUR	600 000	666 628	0,04
Veralto Corp., 4,15 %, 19/09/2031		553 000	615 211	0,04
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,7 %, 15/09/2028	USD	679 000	672 518	0,05
			4 090 792	0,27
Biens de consommation				
JAB Holdings B.V., 2,25 %, 19/12/2039	EUR	1 000 000	824 773	0,06
Kenvue, Inc., 5,05 %, 22/03/2053	USD	1 076 000	1 085 043	0,07
			1 909 816	0,13
Services de consommation				
Compass Group PLC, 3,25 %, 6/02/2031	EUR	260 000	280 533	0,02
Rentokil Initial PLC, 5 %, 27/06/2032	GBP	990 000	1 244 890	0,08
Securitas Treasury Ireland DAC, 4,375 %, 6/03/2029	EUR	455 000	506 985	0,04
			2 032 408	0,14
Équipements électriques				
Arrow Electronics, Inc., 3,25 %, 8/09/2024	USD	389 000	382 922	0,03
Électronique				
Intel Corp., 5,7 %, 10/02/2053		468 000	492 315	0,03
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 3,4 %, 1/05/2030		211 000	192 856	0,01
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 5 %, 15/01/2033		153 000	150 831	0,01
SK hynix, Inc., 5,5 %, 16/01/2029		654 000	661 120	0,05
			1 497 122	0,10
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Bank Gospodarstwa Krajowego (République de Pologne), 6,25 %, 31/10/2028		659 000	691 696	0,05
Bank Gospodarstwa Krajowego (République de Pologne), 5,375 %, 22/05/2033		915 000	918 047	0,06
Corporación Nacional del Cobre de Chile, 5,95 %, 8/01/2034		671 000	671 294	0,04
Emirates NBD Bank PJSC (Émirats arabes unis), 5,875 %, 11/10/2028		867 000	896 351	0,06
First Abu Dhabi Bank PJSC, 6,32 % jusqu'au 4/04/2031, FLR jusqu'au 4/04/2034		824 000	846 143	0,06

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre

Valeurs mobilières et instruments du marché
monétaire négociés sur un marché réglementé

OBLIGATIONS, suite

Obligations quasi souveraines des marchés émergents, suite

		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Magyar Export-Import Bank PLC (République de Hongrie), 6,125 %, 4/12/2027	USD	842 000	848 520	0,06
Qatar Petroleum, 3,125 %, 12/07/2041		830 000	614 134	0,04
SPP-Distribucia A.S. (République de Slovaquie), 1 %, 9/06/2031	EUR	2 620 000	2 104 990	0,14
			7 591 175	0,51

Obligations souveraines des marchés émergents

République tchèque, 2,5 %, 25/08/2028	CZK	37 910 000	1 571 523	0,11
République tchèque, 2 %, 13/10/2033		41 000 000	1 524 034	0,10
Hellenic Republic (République de Grèce), 3,375 %, 15/06/2034	EUR	2 175 000	2 352 403	0,16
Royaume d'Arabie Saoudite, 5,75 %, 16/01/2054	USD	683 000	671 191	0,04
République orientale d'Uruguay, 8,25 %, 21/05/2031	UYU	50 205 000	1 207 766	0,08
République orientale d'Uruguay, 9,75 %, 20/07/2033		48 926 000	1 288 084	0,09
République populaire de Chine, 3,13 %, 21/11/2029	CNY	108 340 000	15 709 812	1,05
République populaire de Chine, 2,88 %, 25/02/2033		101 980 000	14 661 551	0,98
République de Hongrie, 4 %, 25/07/2029	EUR	2 200 000	2 357 331	0,16
République de Corée, 2,375 %, 10/12/2027	KRW	3 100 000 000	2 249 258	0,15
République de Corée, 1,875 %, 10/06/2029		13 768 320 000	9 604 850	0,64
République de Corée, 1,375 %, 10/06/2030		12 430 630 000	8 258 790	0,55
République de Pologne, 3,625 %, 11/01/2034	EUR	1 209 000	1 313 335	0,09
République de Roumanie, 6,375 %, 18/09/2033		535 000	613 890	0,04
République de Roumanie, 6,375 %, 30/01/2034	USD	576 000	590 072	0,04
États-Unis du Mexique, 7,5 %, 3/06/2027	MXN	73 600 000	4 047 433	0,27
États-Unis du Mexique, 2,659 %, 24/05/2031	USD	384 000	321 987	0,02
États-Unis du Mexique, 7,75 %, 29/05/2031	MXN	119 600 000	6 423 162	0,43
États-Unis du Mexique, 6,338 %, 4/05/2053	USD	830 000	827 348	0,06
États-Unis du Mexique, 3,771 %, 24/05/2061		913 000	596 391	0,04
			76 190 211	5,10

Énergie - Sociétés indépendantes

Occidental Petroleum Corp., 6,45 %, 15/09/2036		922 000	983 543	0,07
Pioneer Natural Resources Co., 2,15 %, 15/01/2031		999 000	851 000	0,06
Santos Finance Ltd., 6,875 %, 19/09/2033		735 000	782 515	0,05
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 4 %, 15/08/2026		5 325 000	5 014 393	0,33
			7 631 451	0,51

Énergie - Sociétés intégrées

BP Capital Markets America, Inc., 4,812 %, 13/02/2033		575 000	574 428	0,04
BP Capital Markets B.V., 4,323 %, 12/05/2035	EUR	750 000	851 846	0,06
BP Capital Markets B.V., 0,933 %, 4/12/2040		660 000	461 081	0,03
Eni S.p.A., 3,875 %, 15/01/2034		460 000	503 482	0,03
Exxon Mobil Corp., 1,408 %, 26/06/2039		810 000	635 800	0,04
			3 026 637	0,20

Ingénierie - Construction

John Deere Bank S.A., 5,125 %, 18/10/2028	GBP	603 000	785 564	0,05
---	-----	---------	---------	------

Établissements financiers

Avolon Holdings Funding Ltd., 4,375 %, 1/05/2026	USD	672 000	651 800	0,04
Corporacion Inmobiliaria Vesta S.A.B. de C.V., 3,625 %, 13/05/2031		912 000	770 646	0,05
CTP N.V., 0,875 %, 20/01/2026	EUR	710 000	719 425	0,05
CTP N.V., 4,75 %, 5/02/2030		210 000	228 801	0,02
Grand City Properties S.A., 1,5 % jusqu'au 9/06/2026, FLR jusqu'au 9/12/2069		1 000 000	572 069	0,04
Heimstaden Bostad Treasury B.V., 1 %, 13/04/2028		910 000	760 919	0,05
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 3 %, 14/01/2025		680 000	654 040	0,04
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,375 %, 4/09/2026		615 000	509 710	0,04
SBB Treasury Oyj, 0,75 %, 14/12/2028		633 000	430 117	0,03
VGP N.V., 1,5 %, 8/04/2029		700 000	624 096	0,04
Vonovia SE, 5,5 %, 18/01/2036	GBP	600 000	749 157	0,05
			6 670 780	0,45

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev S.A./N.V., 2 %, 23/01/2035	EUR	995 000	953 644	0,06
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4 %, 13/04/2028	USD	405 000	398 491	0,03
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4,375 %, 15/04/2038		712 000	677 161	0,04
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 5,55 %, 23/01/2049		450 000	476 228	0,03
Bacardi Ltd., 5,15 %, 15/05/2038		724 000	701 107	0,05
Bacardi-Martini B.V., 5,4 %, 15/06/2033		578 000	580 912	0,04
Carlsberg Breweries A.S., 4,25 %, 5/10/2033	EUR	380 000	435 052	0,03
Constellation Brands, Inc., 4,4 %, 15/11/2025	USD	397 000	392 981	0,03
Constellation Brands, Inc., 3,15 %, 1/08/2029		428 000	395 189	0,03
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		435 000	362 942	0,02
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3 %, 2/02/2029		677 000	598 735	0,04
JDE Peet's N.V., 4,5 %, 23/01/2034	EUR	240 000	270 781	0,02
JM Smucker Co., 6,5 %, 15/11/2053	USD	428 000	483 586	0,03
Kraft Heinz Foods Co., 3,875 %, 15/05/2027		695 000	679 474	0,05
PT Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, 3,398 %, 9/06/2031		708 000	608 283	0,04
			8 014 566	0,54
Jeux et hôtellerie				
IHG Finance LLC, 4,375 %, 28/11/2029	EUR	200 000	224 621	0,02
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031	USD	930 000	807 514	0,05
			1 032 135	0,07
Industrie				
Arcadis N.V., 4,875 %, 28/02/2028	EUR	568 000	639 840	0,04
Assurances				
Allianz SE, 4,851 % jusqu'au 26/07/2034, FLR jusqu'au 26/07/2054		600 000	664 649	0,04
Allianz SE, 3,2 % jusqu'au 30/04/2028, FLR jusqu'au 30/04/2171	USD	1 400 000	1 116 888	0,08
ASR Nederland N.V., 7 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2043	EUR	840 000	1 025 238	0,07
Assicurazioni Generali S.p.A., 3,547 %, 15/01/2034		1 420 000	1 529 315	0,10
Axa S.A., 6,375 % jusqu'au 16/01/2034, FLR jusqu'au 16/07/2172		330 000	363 318	0,02
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042	USD	1 155 000	988 581	0,07
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		674 000	691 965	0,05
Groupe des Assurances du Credit Mutuel, 1,85 % jusqu'au 21/04/2032, FLR jusqu'au 21/04/2042	EUR	900 000	786 836	0,05
Sogecap S.A., 6,5 % jusqu'au 16/05/2034, FLR jusqu'au 16/05/2044		200 000	234 800	0,02
			7 401 590	0,50
Assurances - Santé				
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035	USD	208 000	208 022	0,01
Assurances IARD				
American International Group, Inc., 5,125 %, 27/03/2033		695 000	703 391	0,05
Aon Corp./Aon Global Holdings PLC, 3,9 %, 28/02/2052		657 000	517 874	0,04
Arthur J. Gallagher & Co., 6,5 %, 15/02/2034		416 000	456 344	0,03
Arthur J. Gallagher & Co., 6,75 %, 15/02/2054		560 000	647 312	0,04
Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,25 %, 6/12/2027	CAD	1 655 000	1 207 019	0,08
QBE Insurance Group Ltd., 2,5 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2038	GBP	688 000	737 131	0,05
RenaissanceRe Holdings Ltd., 5,75 %, 5/06/2033	USD	901 000	913 987	0,06
			5 183 058	0,35
Obligations quasi souveraines du marché international				
Belfius Bank S.A. (Royaume de Belgique), 3,75 %, 22/01/2029	EUR	200 000	216 499	0,02
Belfius Bank S.A. (Royaume de Belgique), 4,125 %, 12/09/2029		600 000	670 018	0,05
Deutsche Bahn Finance GmbH, 3,375 %, 29/01/2038		180 000	195 041	0,01
Enbw International Finance B.V. (République fédérale d'Allemagne), 4,3 %, 23/05/2034		525 000	597 892	0,04
Logicor Financing S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 4,625 %, 25/07/2028		310 000	337 973	0,02
Logicor Financing S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 1,625 %, 17/01/2030		720 000	660 292	0,04
NBN Co. Ltd. (Commonwealth d'Australie), 5,75 %, 6/10/2028	USD	946 000	984 154	0,07
NBN Co. Ltd. (Commonwealth d'Australie), 4,375 %, 15/03/2033	EUR	417 000	476 230	0,03
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties, 2,5 %, 15/10/2031	USD	993 000	799 450	0,05

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre

Valeurs mobilières et instruments du marché
monétaire négociés sur un marché réglementé

OBLIGATIONS, suite

Obligations quasi souveraines du marché international, suite

		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
P3 Group S.à r.l. (Grand-Duché de Luxembourg), 1,625 %, 26/01/2029	EUR	810 000	763 670	0,05
			5 701 219	0,38

Obligations souveraines du marché international

Commonwealth d'Australie, 3,25 %, 21/06/2039	AUD	8 373 000	4 879 280	0,33
Commonwealth d'Australie, 2,75 %, 21/05/2041		2 207 000	1 171 646	0,08
République fédérale d'Allemagne, 2,1 %, 12/04/2029	EUR	5 500 000	5 960 375	0,40
République fédérale d'Allemagne, 2,6 %, 15/08/2033		3 150 000	3 542 171	0,24
Gouvernement des Bermudes, 2,375 %, 20/08/2030	USD	464 000	390 363	0,03
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		210 000	203 700	0,01
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		1 269 000	1 230 930	0,08
Gouvernement du Canada, 1,25 %, 1/06/2030	CAD	10 694 000	7 010 975	0,47
Gouvernement du Canada, 2 %, 1/06/2032		2 922 000	1 959 997	0,13
Gouvernement du Japon, 2,1 %, 20/12/2027	JPY	187 050 000	1 364 545	0,09
Gouvernement du Japon, 2,4 %, 20/06/2028		1 454 000 000	10 802 752	0,72
Gouvernement du Japon, 0,3 %, 20/12/2039		1 617 000 000	9 483 038	0,63
Gouvernement du Japon, 2,3 %, 20/03/2040		309 000 000	2 411 493	0,16
Gouvernement du Japon, 1,7 %, 20/06/2044		900 950 000	6 300 651	0,42
Gouvernement du Japon, 0,3 %, 20/06/2046		326 250 000	1 673 965	0,11
Gouvernement du Japon, 0,4 %, 20/03/2050		720 500 000	3 535 531	0,24
Gouvernement de Nouvelle-Zélande, 3,5 %, 14/04/2033	NZD	1 529 000	860 497	0,06
Royaume de Belgique, 3 %, 22/06/2033	EUR	2 911 000	3 226 303	0,22
Royaume de Belgique, 0,4 %, 22/06/2040		3 104 000	2 201 769	0,15
Royaume d'Espagne, 2,55 %, 31/10/2032		2 138 000	2 235 315	0,15
Royaume d'Espagne, 3,15 %, 30/04/2033		13 438 000	14 651 699	0,98
Royaume d'Espagne, 3,25 %, 30/04/2034		1 886 000	2 057 083	0,14
Royaume d'Espagne, 3,9 %, 30/07/2039		5 942 000	6 694 410	0,45
Royaume d'Espagne, 1 %, 31/10/2050		1 304 000	766 194	0,05
République de Finlande, 2,95 %, 15/04/2055		1 150 000	1 241 480	0,08
République d'Islande, 2,5 %, 15/04/2024	ISK	155 000 000	1 112 737	0,07
République italienne, 0,5 %, 15/07/2028	EUR	3 395 000	3 293 179	0,22
République italienne, 4,1 %, 1/02/2029		8 078 000	9 133 113	0,61
République italienne, 1,45 %, 1/03/2036		2 580 000	2 140 629	0,14
République italienne, 4,15 %, 1/10/2039		969 000	1 043 847	0,07
Titres du Trésor britannique, 0,375 %, 22/10/2030	GBP	8 773 000	8 973 047	0,60
Titres du Trésor britannique, 1,75 %, 7/09/2037		1 087 000	1 038 952	0,07
Titres du Trésor britannique, 1,25 %, 22/10/2041		1 270 000	1 001 574	0,07
			123 593 240	8,27

Autorités locales

Province de la Colombie-Britannique, 2,95 %, 18/06/2050	CAD	635 000	377 854	0,03
---	-----	---------	---------	------

Machines et outils

Ashtead Capital, Inc., 5,95 %, 15/10/2033	USD	869 000	885 055	0,06
CNH Industrial Capital LLC, 1,875 %, 15/01/2026		209 000	196 802	0,01
CNH Industrial Capital LLC, 5,5 %, 12/01/2029		876 000	900 868	0,06
			1 982 725	0,13

Grandes banques

Banco BPM S.p.A., 4,625 %, 29/11/2027	EUR	500 000	556 924	0,04
Bank of America Corp., 5,202 % jusqu'au 25/04/2028, FLR jusqu'au 25/04/2029	USD	995 000	1 003 139	0,07
Bank of America Corp., 2,687 % jusqu'au 22/04/2031, FLR jusqu'au 22/04/2032		824 000	699 510	0,05
BNP Paribas, 4,75 %, 13/11/2032	EUR	800 000	916 423	0,06
BNP Paribas S.A., FLR, 5,97 %, 23/03/2172	USD	2 030 000	2 020 865	0,13
Capital One Financial Corp., 6,377 % jusqu'au 8/06/2033, FLR jusqu'au 8/06/2034		584 000	606 794	0,04
Commonwealth Bank of Australia, 2,688 %, 11/03/2031		1 564 000	1 300 604	0,09
Credit Agricole S.A., 6,316 % jusqu'au 3/10/2028, FLR jusqu'au 3/10/2029		948 000	988 578	0,07
Credit Agricole S.A., 3,75 %, 22/01/2034	EUR	200 000	218 524	0,01
HSBC Holdings PLC, 2,099 % jusqu'au 4/06/2025, FLR jusqu'au 4/06/2026	USD	822 000	786 014	0,05

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
HSBC Holdings PLC, 6,8 %, 14/09/2031	GBP	510 000	696 277	0,05
HSBC Holdings PLC, 4,856 % jusqu'au 23/05/2032, FLR jusqu'au 23/05/2033	EUR	680 000	782 427	0,05
JPMorgan Chase & Co., 1,47 % jusqu'au 22/09/2026, FLR jusqu'au 22/09/2027	USD	646 000	589 663	0,04
JPMorgan Chase & Co., 5,04 % jusqu'au 23/01/2027, FLR jusqu'au 23/01/2028		587 000	589 511	0,04
JPMorgan Chase & Co., 1,953 % jusqu'au 4/02/2031, FLR jusqu'au 4/02/2032		997 000	813 828	0,05
JPMorgan Chase & Co., 3,109 % jusqu'au 22/04/2050, FLR jusqu'au 22/04/2051		368 000	262 540	0,02
Lloyds Banking Group PLC, 4,75 % jusqu'au 21/09/2030, FLR jusqu'au 21/09/2031	EUR	520 000	589 398	0,04
mBank S.A., 0,966 % jusqu'au 21/09/2026, FLR jusqu'au 21/09/2027		900 000	849 836	0,06
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 1,412 %, 17/07/2025	USD	1 047 000	992 801	0,07
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,494 % jusqu'au 13/10/2031, FLR jusqu'au 13/10/2032		520 000	435 348	0,03
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		1 174 000	1 126 601	0,08
Morgan Stanley, 1,593 % jusqu'au 4/05/2026, FLR jusqu'au 4/05/2027		459 000	425 076	0,03
Morgan Stanley, 5,424 % jusqu'au 21/07/2033, FLR jusqu'au 21/07/2034		404 000	409 233	0,03
NatWest Markets PLC, 3,625 %, 9/01/2029	EUR	600 000	650 818	0,04
PNC Financial Services Group, Inc., 5,3 % jusqu'au 21/01/2027, FLR jusqu'au 21/01/2028	USD	411 000	414 639	0,03
PNC Financial Services Group, Inc., 5,676 % jusqu'au 22/01/2034, FLR jusqu'au 22/01/2035		489 000	501 812	0,03
Société Générale S.A., 5,625 %, 2/06/2033	EUR	500 000	575 479	0,04
UBS Group AG, 2,746 % jusqu'au 11/02/2032, FLR jusqu'au 11/02/2033	USD	1 734 000	1 421 564	0,09
UBS Group AG, 4,125 % jusqu'au 9/06/2032, FLR jusqu'au 9/06/2033	EUR	590 000	644 544	0,04
UBS Group AG, 9,25 % jusqu'au 13/11/2028, FLR jusqu'au 13/05/2172	USD	493 000	527 357	0,03
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026		1 160 000	1 098 914	0,07
UniCredit S.p.A., 4,3 %, 23/01/2031	EUR	1 250 000	1 358 292	0,09
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033	USD	794 000	696 926	0,05
			25 550 259	1,71
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance Corp., 3,8 %, 23/09/2049		294 000	233 693	0,01
CVS Health Corp., 5,625 %, 21/02/2053		490 000	487 896	0,03
HCA, Inc., 5,25 %, 15/06/2026		445 000	446 274	0,03
HCA, Inc., 5,125 %, 15/06/2039		308 000	294 933	0,02
IQVIA, Inc., 6,25 %, 1/02/2029		572 000	595 290	0,04
Memorial Sloan-Kettering Cancer Center, 2,955 %, 1/01/2050		779 000	539 539	0,04
New York Society for the Relief of the Ruptured & Crippled, 2,667 %, 1/10/2050		1 400 000	866 844	0,06
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 6,015 %, 15/11/2048		737 000	776 678	0,05
Thermo Fisher Scientific (Finance I) B.V., 2 %, 18/10/2051	EUR	720 000	549 763	0,04
Thermo Fisher Scientific, Inc., 4,977 %, 10/08/2030	USD	570 000	582 692	0,04
			5 373 602	0,36
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 5,625 %, 1/04/2030		700 000	709 814	0,05
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031		829 000	716 531	0,05
			1 426 345	0,10
Secteur intermédiaire				
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 5,927 %, 15/08/2030		843 000	876 287	0,06
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 6,036 %, 15/11/2033		447 000	469 288	0,03
Enbridge, Inc., 5,7 %, 8/03/2033		380 000	392 024	0,03
Enbridge, Inc., 8,5 % jusqu'au 15/01/2034, FLR jusqu'au 15/01/2084		734 000	784 716	0,05
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028		548 000	557 643	0,04
Energy Transfer LP, 5,95 %, 15/05/2054		529 000	530 504	0,03
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,16 %, 31/03/2034		992 995	852 251	0,06
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		315 000	288 355	0,02
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		615 000	536 344	0,03
			5 287 412	0,35
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 4,5 %, 1/03/2025–1/02/2046		4 254 631	4 211 751	0,27
Fannie Mae, 3 %, 1/12/2032		6 185	5 866	0,00
Fannie Mae, 5 %, 1/11/2033–1/08/2040		1 178 110	1 186 015	0,09

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS **au 31 janvier 2024**
MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Fannie Mae, 6 %, 1/09/2037–1/06/2038	USD	161 019	166 958	0,01
Fannie Mae, 4 %, 1/11/2040–1/12/2040		1 056 953	1 012 363	0,06
Fannie Mae, 3,5 %, 1/05/2043–1/12/2046		2 370 040	2 195 423	0,15
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/10/2036–1/05/2052		9 980 404	8 167 561	0,55
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/07/2037–1/06/2052		4 189 497	3 728 085	0,25
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/01/2050–1/06/2052		6 307 011	5 329 549	0,33
Fannie Mae, UMBS, 1,5 %, 1/04/2052		1 161 163	893 112	0,06
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/11/2052–1/11/2053		2 563 425	2 575 965	0,18
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/10/2053–1/11/2053		1 720 634	1 745 172	0,12
Freddie Mac, 3,35 %, 25/01/2028		4 830 000	4 656 981	0,31
Freddie Mac, 3,6 %, 25/01/2028		4 870 000	4 729 490	0,32
Freddie Mac, 3,9 %, 25/04/2028		4 120 000	4 043 632	0,27
Freddie Mac, 5,989 %, 25/03/2029		942 581	941 657	0,06
Freddie Mac, 5,978 %, 25/07/2029–25/09/2029		2 076 866	2 073 788	0,14
Freddie Mac, 5,979 %, 25/08/2029		862 090	860 506	0,06
Freddie Mac, 1,44 %, 25/01/2030 (i)		7 207 791	463 080	0,03
Freddie Mac, 1,21 %, 25/06/2030 (i)		8 103 587	465 224	0,03
Freddie Mac, 1,482 %, 25/06/2030 (i)		8 841 570	612 191	0,04
Freddie Mac, 0,871 %, 25/02/2032 (i)		13 482 921	679 880	0,05
Freddie Mac, 0,301 %, 25/11/2032 (i)		19 376 361	283 802	0,02
Freddie Mac, 0,299 %, 25/08/2033 (i)		16 930 400	244 583	0,02
Freddie Mac, 5 %, 1/10/2035–1/07/2041		547 879	553 595	0,03
Freddie Mac, 5,5 %, 1/07/2037		29 978	30 875	0,00
Freddie Mac, 4,5 %, 1/07/2039–1/05/2042		1 613 796	1 607 342	0,10
Freddie Mac, 3,5 %, 1/12/2042–1/04/2043		224 422	210 289	0,01
Freddie Mac Multi-Family Structured Pass-Through Certificates K-511, "X-1", 0,612 %, 25/10/2028 (i)		7 183 008	140 527	0,01
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/11/2036–1/09/2052		4 795 766	4 043 003	0,27
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/01/2047		1 035 664	961 493	0,06
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/06/2050–1/06/2052		1 468 815	1 287 595	0,09
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/08/2051–1/02/2052		304 857	246 645	0,01
Freddie Mac, UMBS, 4 %, 1/05/2052–1/04/2053		1 456 721	1 372 319	0,09
Freddie Mac, UMBS, 6 %, 1/11/2052–1/10/2053		726 754	738 268	0,05
Freddie Mac, UMBS, 5,5 %, 1/02/2053		456 687	458 969	0,03
Ginnie Mae, 5 %, 15/05/2040–20/04/2053		889 865	887 456	0,06
Ginnie Mae, 3,5 %, 20/06/2043		973 566	912 041	0,06
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/08/2051–20/09/2052		3 641 567	3 148 570	0,22
Ginnie Mae, 3 %, 20/10/2051–20/10/2052		2 264 348	2 023 425	0,14
Ginnie Mae, 2 %, 20/01/2052–20/03/2052		1 374 000	1 144 226	0,08
Ginnie Mae, 4 %, 20/07/2052–20/10/2052		1 105 854	1 050 208	0,07
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/09/2052–20/11/2052		1 560 218	1 518 818	0,10
Ginnie Mae, 5,5 %, 20/02/2053–20/04/2053		915 231	921 454	0,06
Ginnie Mae, TBA, 6 %, 20/02/2054		700 000	710 676	0,05
Ginnie Mae, TBA, 6,5 %, 20/02/2054–20/03/2054		150 000	153 241	0,02
UMBS, TBA, 2 %, 25/02/2039–25/03/2039		700 000	628 823	0,05
UMBS, TBA, 2,5 %, 25/02/2039		100 000	92 086	0,01
UMBS, TBA, 6,5 %, 13/02/2054		75 000	76 775	0,01
UMBS, TBA, 3,5 %, 25/02/2054–25/03/2054		1 350 000	1 228 916	0,08
			77 420 269	5,18
Obligations municipales				
Colorado Housing & Finance Authority Rev., Single Family Mortgage Class I, Taxable, "D-1", GNMA, 5 %, 1/11/2047		780 000	771 651	0,05
Connecticut Higher Education Supplemental Loan Authority Rev., Taxable (Chesla Loan Program), "C", 4,668 %, 15/11/2034		1 350 000	1 260 996	0,09
Iowa Student Loan Liquidity Corp. Rev., Taxable, "A", 5,08 %, 1/12/2039		650 000	629 277	0,04
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, Issue M, "A", 2,641 %, 1/07/2037		1 270 000	1 102 256	0,07
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, Issue M, "A", 4,949 %, 1/07/2038		1 935 000	1 785 464	0,12

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations municipales, suite				
Massachusetts Housing Finance Agency, Single Family Housing Rev., Taxable, "226", 5,562 %, 1/12/2052	USD	1 210 000	1 218 130	0,08
Michigan Finance Authority Hospital Rev., Taxable (Trinity Health Credit Group), 3,384 %, 1/12/2040		695 000	566 838	0,04
Minnesota Housing Finance Agency, Residential Housing, Taxable, "G", 4,337 %, 1/01/2047		1 090 000	1 058 258	0,07
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), "C", AGM, 4,65 %, 15/08/2030		1 378 000	1 295 604	0,09
			9 688 474	0,65
Gaz naturel - Distribution				
Boston Gas Co., 3,15 %, 1/08/2027		536 000	500 653	0,03
ENGIE Energía Chile S.A., 3,875 %, 6/12/2033	EUR	400 000	444 060	0,03
ENGIE S.A., 4,5 %, 6/09/2042		400 000	458 334	0,03
ENGIE S.A., 4,25 %, 11/01/2043		100 000	111 135	0,01
Infraestructura Energética Nova S.A.B. de C.V., 4,875 %, 14/01/2048	USD	900 000	701 807	0,05
			2 215 989	0,15
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 0,75 %, 15/03/2029	EUR	1 040 000	981 212	0,06
APA Infrastructure Ltd., 2,5 %, 15/03/2036	GBP	1 260 000	1 146 498	0,08
			2 127 710	0,14
Réseaux et télécommunications				
Orange S.A., 3,875 %, 11/09/2035	EUR	500 000	566 701	0,04
Services pétroliers				
EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 5,25 %, 23/01/2084		200 000	219 520	0,01
Pétrole				
Neste Oyj, 3,875 %, 21/05/2031		245 000	272 853	0,02
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
ABANCA Corp. Bancaria S.A., 5,875 % jusqu'au 2/04/2029, FLR jusqu'au 2/04/2030		1 000 000	1 156 263	0,08
AIB Group PLC, 6,608 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2029	USD	1 107 000	1 162 964	0,08
AIB Group PLC, 5,25 %, 23/10/2031	EUR	680 000	785 950	0,05
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 4,375 %, 11/01/2034		400 000	427 957	0,03
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 3,75 %, 3/02/2034		300 000	325 551	0,02
BPCE S.A., 4,5 %, 15/03/2025	USD	801 000	788 372	0,05
BPCE S.A., 2,277 % jusqu'au 20/01/2031, FLR jusqu'au 20/01/2032		1 100 000	886 652	0,06
BPCE S.A., 4,75 % jusqu'au 14/06/2033, FLR jusqu'au 14/06/2034	EUR	400 000	459 458	0,03
BPCE S.A., 4,25 % jusqu'au 11/01/2034, FLR jusqu'au 11/01/2035		700 000	771 473	0,05
CaixaBank S.A., 5 % jusqu'au 19/07/2028, FLR jusqu'au 19/07/2029		500 000	565 218	0,04
CaixaBank S.A., 4,25 %, 6/09/2030		400 000	449 471	0,03
Deutsche Bank AG, 3,75 % jusqu'au 15/01/2029, FLR jusqu'au 15/01/2030		600 000	651 548	0,04
Deutsche Bank AG, 6,125 % jusqu'au 12/12/2029, FLR jusqu'au 12/12/2030	GBP	700 000	893 402	0,06
Deutsche Bank AG, 1,375 % jusqu'au 17/02/2031, FLR jusqu'au 17/02/2032	EUR	500 000	448 340	0,03
Deutsche Bank AG, 4 % jusqu'au 24/06/2027, FLR jusqu'au 24/06/2032		500 000	521 074	0,03
Intesa Sanpaolo S.p.A., 5,125 %, 29/08/2031		580 000	675 788	0,05
Intesa Sanpaolo S.p.A., 7,2 %, 28/11/2033	USD	1 371 000	1 468 797	0,10
KBC Group N.V., 4,75 %, 17/04/2035	EUR	800 000	870 301	0,06
Macquarie Group Ltd., 4,747 %, 23/01/2030		505 000	572 621	0,04
Macquarie Group Ltd., 6,255 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2034	USD	541 000	568 334	0,04
Manufacturers and Traders Trust Co., 4,7 %, 27/01/2028		790 000	774 309	0,05
Truist Financial Corp., 5,711 % jusqu'au 24/01/2034, FLR jusqu'au 24/01/2035		349 000	354 884	0,02
Virgin Money UK PLC, 7,625 %, 23/08/2029	GBP	670 000	906 439	0,06
			16 485 166	1,10
Produits pharmaceutiques				
Bayer US Finance LLC, 6,375 %, 21/11/2030	USD	935 000	954 416	0,06
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 4,75 %, 19/05/2033		770 000	769 046	0,05
Roche Holdings, Inc., 5,489 %, 13/11/2030		1 203 000	1 267 653	0,09
			2 991 115	0,20
Lutte contre la pollution				
Waste Management, Inc., 4,625 %, 15/02/2033		812 000	806 184	0,05

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Métaux et minéraux précieux				
Northern Star Resources Ltd. Co., 6,125 %, 11/04/2033	USD	705 000	718 549	0,05
Immobilier - Bureaux				
Boston Properties LP, REIT, 3,65 %, 1/02/2026		654 000	631 606	0,04
Corporate Office Property LP, REIT, 2,25 %, 15/03/2026		742 000	697 083	0,05
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		452 000	379 760	0,02
Corporate Office Property LP, REIT, 2,75 %, 15/04/2031		332 000	271 043	0,02
			1 979 492	0,13
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		943 000	788 693	0,05
Extra Space Storage LP, 5,5 %, 1/07/2030		789 000	806 871	0,05
Lexington Realty Trust Co., REIT, 2,7 %, 15/09/2030		821 000	690 699	0,05
			2 286 263	0,15
Immobilier - Distribution				
STORE Capital Corp., REIT, 2,7 %, 1/12/2031		1 188 000	930 968	0,06
WEA Finance LLC, 2,875 %, 15/01/2027		1 013 000	916 123	0,06
			1 847 091	0,12
Restaurants				
McDonald's Corp., 3,875 %, 20/02/2031	EUR	590 000	660 469	0,04
Distribution				
AutoZone, Inc., 4,75 %, 1/08/2032	USD	596 000	585 688	0,04
Home Depot, Inc., 4,875 %, 15/02/2044		228 000	223 660	0,01
Home Depot, Inc., 3,625 %, 15/04/2052		666 000	526 818	0,04
			1 336 166	0,09
Produits chimiques spéciaux				
Covestro AG, 1,375 %, 12/06/2030	EUR	810 000	776 626	0,05
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027	USD	522 000	462 522	0,03
International Flavors & Fragrances, Inc., 4,375 %, 1/06/2047		548 000	425 813	0,03
			1 664 961	0,11
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		797 000	677 659	0,05
Organismes supranationaux				
European Financial Stability Facility, 3 %, 4/09/2034	EUR	3 134 000	3 442 467	0,23
Banque européenne d'investissement, 3 %, 15/02/2039		1 300 000	1 403 157	0,09
European Union, 3,25 %, 4/07/2034		2 861 000	3 212 516	0,22
European Union, 2,625 %, 4/02/2048		1 500 000	1 473 447	0,10
European Union, 3 %, 4/03/2053		2 225 000	2 290 866	0,15
			11 822 453	0,79
Télécommunications mobiles				
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032	USD	887 000	806 805	0,05
T-Mobile USA, Inc., 3,875 %, 15/04/2030		726 000	686 580	0,05
T-Mobile USA, Inc., 5,75 %, 15/01/2034		574 000	604 743	0,04
Vodafone Group PLC, 3,375 %, 8/08/2049	GBP	790 000	685 279	0,05
Vodafone Group PLC, 5,625 %, 10/02/2053	USD	577 000	581 275	0,04
			3 364 682	0,23
Services téléphoniques				
Deutsche Telekom AG, 1,375 %, 5/07/2034	EUR	865 000	804 443	0,06
TELUS Corp., 2,85 %, 13/11/2031	CAD	1 910 000	1 237 803	0,08
			2 042 246	0,14
Tabac				
B.A.T. International Finance PLC, 2,25 %, 16/01/2030	EUR	770 000	747 777	0,05
Transports - Services				
Aeroporto di Roma S.p.A., 4,875 %, 10/07/2033		1 010 000	1 147 854	0,08
Autostrade per l'Italia S.p.A., 5,125 %, 14/06/2033		370 000	419 916	0,03
Autostrade per l'Italia S.p.A., 4,75 %, 24/01/2031		760 000	850 537	0,06
Element Fleet Management Corp., 6,271 %, 26/06/2026	USD	541 000	550 778	0,04

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Transports - Services, suite				
Element Fleet Management Corp., 6,319 %, 4/12/2028	USD	956 000	993 460	0,06
Transurban Finance Co. Pty Ltd., 4,225 %, 26/04/2033	EUR	695 000	787 094	0,05
Triton International Ltd., 3,15 %, 15/06/2031	USD	866 000	695 729	0,05
United Parcel Service, 5,05 %, 3/03/2053		963 000	974 316	0,06
			6 419 684	0,43
Sociétés publiques fédérales américaines et sociétés similaires				
Small Business Administration, 5,31 %, 1/05/2027		23 957	23 652	0,00
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 3,875 %, 15/05/2043		5 544 000	5 216 558	0,35
Obligations du Trésor américain, 4,375 %, 15/08/2043		486 000	489 493	0,03
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/11/2049		6 787 000	4 738 174	0,32
Obligations du Trésor américain, 3,625 %, 15/05/2053		1 102 000	990 250	0,07
Bons du Trésor américain, 3,75 %, 31/12/2028		5 308 000	5 277 728	0,35
Bons du Trésor américain, 4,875 %, 31/10/2030		8 921 000	9 417 231	0,63
Bons du Trésor américain, 2,75 %, 15/08/2032		4 952 000	4 523 923	0,30
			30 653 357	2,05
Services publics - Énergie électrique				
American Electric Power Co., Inc., 5,699 %, 15/08/2025		214 000	215 646	0,01
American Electric Power Co., Inc., 2,3 %, 1/03/2030		467 000	402 309	0,03
Berkshire Hathaway Energy Co., 5,15 %, 15/11/2043		197 000	195 235	0,01
Berkshire Hathaway Energy Co., 4,6 %, 1/05/2053		164 000	144 869	0,01
Bruce Power LP, 2,68 %, 21/12/2028	CAD	1 700 000	1 159 874	0,08
Duke Energy Florida LLC, 6,2 %, 15/11/2053	USD	519 000	580 791	0,04
E.ON International Finance B.V., 5,875 %, 30/10/2037	GBP	600 000	789 743	0,05
EDP Servicios Financieros Espana S.A., 4,375 %, 4/04/2032	EUR	456 000	524 786	0,03
Enel Americas S.A., 4 %, 25/10/2026	USD	2 170 000	2 103 837	0,14
Enel Finance International N.V., 3,875 %, 23/01/2035	EUR	780 000	853 397	0,06
Enel Finance International N.V., 4,75 %, 25/05/2047	USD	764 000	667 888	0,04
EPH Financing International A.S., 6,651 %, 13/11/2028	EUR	1 050 000	1 159 490	0,08
Eversource Energy, 5,5 %, 1/01/2034	USD	524 000	530 005	0,04
Florida Power & Light Co., 2,875 %, 4/12/2051		646 000	437 552	0,03
Georgia Power Co., 4,95 %, 17/05/2033		968 000	968 316	0,06
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		667 000	562 177	0,04
National Grid Electricity Transmission PLC, 2 %, 17/04/2040	GBP	570 000	455 982	0,03
National Grid PLC, 4,275 %, 16/01/2035	EUR	450 000	498 780	0,03
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 6,051 %, 1/03/2025	USD	284 000	286 394	0,02
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 5,749 %, 1/09/2025		250 000	252 525	0,02
Pacific Gas & Electric Co., 6,1 %, 15/01/2029		562 000	582 259	0,04
Pacific Gas & Electric Co., 6,4 %, 15/06/2033		257 000	272 820	0,02
PPL Electric Utilities Corp, 1st Mortgage, 5,25 %, 15/05/2053		875 000	881 607	0,06
Southern Co., 1,875 %, 15/09/2081	EUR	100 000	94 102	0,01
SSE PLC, 4 %, 5/09/2031		585 000	657 207	0,04
			15 277 591	1,02
Total des obligations (coût identifié, 577 139 107 \$)			562 214 348	37,60
ACTIONS PRIVILÉGIÉES				
Biens de consommation				
Henkel AG & Co. KGaA		101 355	7 795 238	0,52
Métaux et exploitation minière				
Gerdau S.A.		730 580	3 102 576	0,21
Total des actions privilégiées (coût identifié, 12 828 835 \$)			10 897 814	0,73
OBLIGATIONS CONVERTIBLES				
Services publics - Énergie électrique				
Pacific Gas and Electric Corp., 4,25 %, 1/12/2027 (coût identifié, 691 000 \$)	USD	691 000	703 092	0,05

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Global Total Return Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 1 872 000 \$)	USD	1 872 000	1 871 730	0,12
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 1 359 914 197 \$)			1 473 558 044	98,55
Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice		Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats	
OPTIONS D'ACHAT ACHETÉES				
iTraxx Europe Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notional lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 0,62 %		39 556 602 EUR	35 910 000	80 588 0,00
iTraxx Europe Series 40 Index Credit Default Swap – Le Compartiment reçoit 5 %, le Fonds paie un montant notional lors d'un événement de crédit défini d'un composant de l'indice – Mai 2024 @ 0,63 %		39 556 602	35 910 000	80 588 0,01
Total des Options d'Achat Achetées (primes versées, 88 763 \$)			161 176	0,01
Total des investissements (coût identifié, 1 360 002 960 \$) (k)			1 473 719 220	98,56
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			21 518 520	1,44
ACTIF NET			1 495 237 740	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Inflation-Adjusted Bond Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Créances adossées à des actifs et titrisées				
Arbor Multi-Family Mortgage Securities Trust, 2021-MF3, "XA", 0,739 %, 15/10/2054 (i)	USD	6 295 406	231 015	0,17
BSPDF 2021-FL1 Issuer Ltd., "AS", FLR, 6,927 %, 15/10/2036		445 000	428 693	0,33
PFP III 2021-8 Ltd., "AS", FLR, 6,702 %, 9/08/2037		699 500	678 675	0,52
			1 338 383	1,02
Services de consommation				
Conservation Fund, 3,474 %, 15/12/2029		86 000	78 336	0,06
Industrie				
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,516 %, 1/10/2025		26 000	25 074	0,02
Obligations souveraines du marché international				
République italienne, Obligation indexée sur l'inflation, 2,35 %, 15/09/2035	EUR	1 104 787	1 263 389	0,96
Technologies et services médicaux et de santé				
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,325 %, 15/11/2028	USD	162 000	165 239	0,13
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,75 %, 15/11/2038		79 000	79 015	0,06
			244 254	0,19
Titres adossés à des hypothèques				
Freddie Mac, 1,44 %, 25/01/2030 (i)		1 605 381	103 141	0,08
Freddie Mac, 1,482 %, 25/06/2030 (i)		1 887 526	130 692	0,10
			233 833	0,18
Obligations municipales				
Colorado Health Facilities Authority Rev., Taxable (Covenant Living Communities and Services), "B", 2,8 %, 1/12/2026		155 000	145 881	0,11
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 3 %, 1/06/2046		350 000	323 371	0,25
Luzerne, Carbon and Schuylkill Counties, PA, Hazleton Area School District, General Obligation, Taxable, "B", AGM, 0,833 %, 1/03/2024		610 000	607 775	0,46
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,682 %, 1/07/2027		230 000	216 649	0,17
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, Issue M, "A", 2,641 %, 1/07/2037		1 055 000	915 654	0,70
Michigan Finance Authority Student Loan Asset-Backed Rev., Taxable, "A-1A", 1,3 %, 25/07/2061		254 802	235 871	0,18

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Inflation-Adjusted Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations municipales, suite				
Michigan Finance Authority Tobacco Settlement Asset-Backed Rev., Taxable (2006 Recettes vendues de tabac), "A-1", 2,326 %, 1/06/2030	USD	54 011	53 100	0,04
Rhode Island Student Loan Authority, Education Loan Rev., Taxable, "2", 2,348 %, 1/12/2040		510 000	457 443	0,35
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,497 %, 1/06/2024		190 000	187 551	0,14
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,647 %, 1/06/2025		155 000	147 652	0,11
			3 290 947	2,51
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation				
Obligations du Trésor américain, 3,625 %, 15/04/2028		5 505 418	5 913 808	4,51
Obligations du Trésor américain, 0,75 %, 15/02/2042		10 576 085	8 608 768	6,57
Obligations du Trésor américain, 0,625 %, 15/02/2043		3 023 617	2 369 169	1,81
Obligations du Trésor américain, 0,75 %, 15/02/2045		4 845 404	3 794 431	2,90
Obligations du Trésor américain, 1 %, 15/02/2048		1 685 947	1 355 167	1,03
Obligations du Trésor américain, 0,125 %, 15/02/2051		1 373 966	842 091	0,64
Obligations du Trésor américain, TIPS, 1,125 %, 15/01/2033		3 030 552	2 883 108	2,20
Obligations du Trésor américain, TIPS, 0,125 %, 15/02/2052		4 014 956	2 432 760	1,86
Bons du Trésor américain, 0,625 %, 15/01/2026		11 223 104	10 899 783	8,32
Bons du Trésor américain, 0,375 %, 15/01/2027		5 112 445	4 892 570	3,73
Bons du Trésor américain, 0,375 %, 15/07/2027		7 735 921	7 395 158	5,65
Bons du Trésor américain, 0,5 %, 15/01/2028		6 112 017	5 817 717	4,44
Bons du Trésor américain, 0,875 %, 15/01/2029		22 529 388	21 672 215	16,54
Bons du Trésor américain, 0,125 %, 15/07/2030		14 894 427	13 572 159	10,36
Bons du Trésor américain, 0,125 %, 15/01/2031		11 227 946	10 116 409	7,72
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,125 %, 15/01/2032		18 435 451	16 313 933	12,45
Bons du Trésor américain, TIPS, 1,375 %, 15/07/2033		3 437 434	3 348 813	2,56
			122 228 059	93,29
Total des obligations (coût identifié, 139 212 343 \$)			128 702 275	98,23
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 376 000 \$)	USD	376 000	375 946	0,29
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 139 588 343 \$)			129 078 221	98,52
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			1 934 196	1,48
ACTIF NET			131 012 417	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Japan Equity Fund

(en yen japonais)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (¥)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES				
Boissons alcoolisées				
Kirin Holdings Co. Ltd.		3 600	7 658 032	1,59
Industrie automobile				
Bridgestone Corp.		2 100	13 435 643	2,79
DENSO Corp.		5 600	12 899 230	2,68
Koito Manufacturing Co. Ltd.		3 000	6 781 038	1,41
			33 115 911	6,88
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Japan Exchange Group, Inc.		2 000	6 516 822	1,35
Services aux entreprises				
Nomura Research Institute Ltd.		1 700	7 641 500	1,59

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS **au 31 janvier 2024**
MFS Meridian Funds - Japan Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (¥)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Services aux entreprises, suite			
SCSK Corp.	1 800	5 209 422	1,08
		12 850 922	2,67
Logiciels			
Oracle Corp. Japan	500	5 799 150	1,20
Logiciels - Systèmes			
Fujitsu Ltd.	300	6 234 801	1,29
Hitachi Ltd.	1 700	19 653 828	4,08
NEC Corp.	800	7 687 366	1,60
		33 575 995	6,97
Biens de consommation			
Kao Corp.	1 600	9 358 145	1,94
KOSE Corp.	500	4 849 500	1,01
		14 207 645	2,95
Services de consommation			
Persol Holdings Co. Ltd.	28 100	6 651 270	1,38
Équipements électriques			
Mitsubishi Electric Corp.	5 200	11 270 821	2,34
Électronique			
Amano Corp.	1 300	4 408 674	0,92
DISCO Corp.	100	3 953 271	0,82
Hoya Corp.	200	3 733 866	0,77
Kyocera Corp.	5 200	11 215 229	2,33
Renesas Electronics Corp.	3 500	8 482 793	1,76
ROHM Co. Ltd.	3 100	7 996 450	1,66
Tokyo Electron Ltd.	500	13 643 428	2,83
		53 433 711	11,09
Ingénierie - Construction			
Taisei Corp.	700	3 756 243	0,78
Alimentation et boissons			
Ezaki Glico Co. Ltd.	1 400	6 049 400	1,26
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Seven & I Holdings Co. Ltd.	2 000	11 712 000	2,43
Sugi Holdings Co. Ltd.	1 100	7 745 800	1,61
		19 457 800	4,04
Assurances			
Tokio Marine Holding, Inc.	2 600	10 136 992	2,10
Internet			
LY Corp.	10 500	4 793 399	1,00
Loisirs et jouets			
Yamaha Corp.	1 400	4 556 840	0,95
Machines et outils			
Daikin Industries Ltd.	500	11 828 604	2,45
Keyence Corp.	200	13 204 319	2,74
OSG Corp.	2 200	4 411 955	0,92
SMC Corp.	200	16 381 175	3,40
Toyota Industries Corp.	1 000	12 430 746	2,58
		58 256 799	12,09
Grandes banques			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	9 700	13 386 009	2,78
Resona Holdings, Inc.	2 600	2 123 541	0,44
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	1 700	13 037 876	2,71
		28 547 426	5,93
Équipements médicaux			
Olympus Corp.	3 900	8 504 196	1,77
Shimadzu Corp.	1 400	5 701 229	1,18

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Japan Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (¥)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Équipements médicaux, suite			
Terumo Corp.	1 800	8 943 019	1,86
		23 148 444	4,81
Métaux et exploitation minière			
Itochu Corp.	1 400	9 363 641	1,94
Mitsui & Co. Ltd.	1 500	8 943 343	1,86
		18 306 984	3,80
Produits pharmaceutiques			
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	1 800	9 557 680	1,99
Kyowa Kirin Co. Ltd.	1 100	2 550 894	0,53
Santen Pharmaceutical Co. Ltd.	4 800	7 147 282	1,48
		19 255 856	4,00
Lutte contre la pollution			
Daiseki Co. Ltd.	1 040	4 372 771	0,91
Chemins de fer et transport maritime			
Keisei Electric Railway Co. Ltd.	1 000	6 660 016	1,38
Sankyu, Inc.	1 400	7 710 963	1,60
		14 370 979	2,98
Produits chimiques spéciaux			
FUJIFILM Holdings Corp.	900	8 397 742	1,75
Kansai Paint Co. Ltd.	4 300	10 558 966	2,19
Nitto Denko Corp.	1 100	13 406 430	2,78
Tokyo Ohka Kogyo Co., Ltd.	2 100	7 036 161	1,46
		39 399 299	8,18
Magasins spécialisés			
ZOZO, Inc.	3 100	10 022 866	2,08
Télécommunications mobiles			
KDDI Corp.	2 700	13 149 285	2,73
SoftBank Group Corp.	600	3 817 922	0,79
		16 967 207	3,52
Transport par camion			
Yamato Holdings Co. Ltd.	2 100	5 351 583	1,11
Total des actions ordinaires (coût identifié, 402 325 878 ¥)		471 831 167	97,96
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 402 325 878 ¥) (k)		471 831 167	97,96
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		9 827 666	2,04
ACTIF NET		481 658 833	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS			
Aérospatiale et défense			
Huntington Ingalls Industries, Inc., 3,844 %, 1/05/2025	USD 3 158 000	3 100 553	0,28
Industrie de la confection			
Tapestry, Inc., 7,05 %, 27/11/2025	1 153 000	1 179 434	0,11
Tapestry, Inc., 7 %, 27/11/2026	698 000	719 955	0,06
		1 899 389	0,17
Créances adossées à des actifs et titrisées			
ACREC 2021-FL1 Ltd., "AS", FLR, 6,949 %, 16/10/2036	2 218 000	2 169 729	0,19
ACREC 2021-FL1 Ltd., "B", FLR, 7,249 %, 16/10/2036	1 722 000	1 674 683	0,15

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
ACREC 2021-FL1 Ltd., "C", FLR, 7,599 %, 16/10/2036	USD	2 228 500	2 148 922	0,19
ACREC 2023-FL2 LLC, "A", FLR, 7,563 %, 19/02/2038		2 134 632	2 133 759	0,19
ACRES 2021-FL2 Issuer Ltd., "B", FLR, 7,696 %, 15/01/2037		3 356 500	3 284 939	0,29
Allegro CLO Ltd., 2014-1RA, "A2", FLR, 7,179 %, 21/10/2028		370 984	372 334	0,03
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "B", FLR, 6,947 %, 15/12/2035		815 000	793 411	0,07
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "C", FLR, 7,448 %, 15/12/2035		334 000	324 617	0,03
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL3, "B", FLR, 7,048 %, 15/08/2034		1 129 000	1 089 723	0,10
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL3, "C", FLR, 7,297 %, 15/08/2034		655 000	627 227	0,06
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL4, "AS", FLR, 7,147 %, 15/11/2036		1 500 000	1 478 373	0,13
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL4, "B", FLR, 7,448 %, 15/11/2036		1 500 000	1 473 994	0,13
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL4, "C", FLR, 7,748 %, 15/11/2036		1 618 000	1 570 440	0,14
AREIT 2019-CRE3 Trust, "AS", FLR, 6,752 %, 14/09/2036		733 197	725 511	0,06
AREIT 2019-CRE3 Trust, "B", FLR, 7,002 %, 14/09/2036		520 000	502 206	0,04
AREIT 2019-CRE3 Trust, "C", FLR, 7,352 %, 14/09/2036		430 000	396 227	0,03
AREIT 2022-CRE6 Trust, "C", FLR, 7,495 %, 20/01/2037		894 000	853 133	0,08
AREIT 2022-CRE6 Trust, "D", FLR, 8,195 %, 20/01/2037		1 194 000	1 125 249	0,10
Bain Capital Credit CLO Ltd., 2020-4A, "A1R", FLR, 7,067 %, 20/10/2036		5 000 000	5 014 960	0,44
Ballyrock CLO 2018-1A Ltd., "A2", FLR, 7,179 %, 20/04/2031		2 039 051	2 032 924	0,18
Ballyrock CLO 2018-1A Ltd., "B", FLR, 7,479 %, 20/04/2031		864 096	857 757	0,08
Bayview Financial Revolving Mortgage Loan Trust, FLR, 7,051 %, 28/12/2040		55 072	81 894	0,01
BBCMS Mortgage Trust, 2018-C2, "XA", 0,753 %, 15/12/2051 (i)		27 105 184	769 671	0,07
BDS 2021-FL10 Ltd., "B", FLR, 7,399 %, 16/12/2036		550 000	538 806	0,05
BDS 2021-FL10 Ltd., "C", FLR, 7,749 %, 16/12/2036		400 000	389 313	0,03
BSPRT 2021-FL6 Issuer Ltd., "C", FLR, 7,498 %, 15/03/2036		1 069 000	1 024 031	0,09
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "B", FLR, 7,498 %, 15/12/2038		832 000	814 891	0,07
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "C", FLR, 7,747 %, 15/12/2038		719 000	701 323	0,06
BSPRT 2022-FL8 Issuer Ltd., "A", FLR, 6,846 %, 15/02/2037		4 867 000	4 820 010	0,43
Business Jet Securities LLC, 2020-1A, "A", 2,981 %, 15/11/2035		217 434	210 774	0,02
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "A", 2,162 %, 15/04/2036		500 588	468 292	0,04
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "B", 2,918 %, 15/04/2036		103 152	95 758	0,01
BXMT 2020-FL2 Ltd., "B", FLR, 6,846 %, 15/02/2038		2 765 000	2 402 401	0,21
BXMT 2020-FL2 Ltd., "A", FLR, 6,346 %, 15/02/2038		2 446 050	2 334 391	0,21
BXMT 2021-FL4 Ltd., "AS", FLR, 6,746 %, 15/05/2038		5 130 500	4 775 166	0,42
Capital Automotive, 2020-1A, "A4", REIT, 3,19 %, 15/02/2050		1 018 245	981 117	0,09
C-BASS Mortgage Loan Trust, 2007-CB3, "A3", 3,35 %, 25/03/2037		748 716	270 075	0,02
CD 2017-CD4 Mortgage Trust, "XA", 1,222 %, 10/05/2050 (i)		17 923 315	533 432	0,05
Colt Funding LLC, 2024-1, "A1", 5,835 %, 25/02/2069		7 058 657	7 058 569	0,63
Consumers 2023 Securitization Funding LLC, 5,55 %, 1/03/2028		2 336 000	2 345 386	0,21
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-2A, "A", 0,96 %, 15/02/2030		48 594	48 491	0,00
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-2A, "B", 1,26 %, 15/04/2030		463 000	458 753	0,04
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-3A, "B", 1,38 %, 15/07/2030		612 000	594 585	0,05
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-3A, "C", 1,63 %, 16/09/2030		370 000	355 737	0,03
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-4, "A", 1,26 %, 15/10/2030		487 249	477 876	0,04
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-4, "B", 1,74 %, 16/12/2030		1 180 000	1 132 439	0,10
Cutwater 2015-1A Ltd., "AR", FLR, 6,796 %, 15/01/2029		172 738	172 832	0,02
Dryden Senior Loan Fund, 2022-113A, "A1R", CLO, FLR, 7,045 %, 20/10/2035		7 500 000	7 517 858	0,67
Dryden Senior Loan Fund, 2022-113A, "BR", FLR, 7,568 %, 20/10/2035		5 500 000	5 497 905	0,49
Empire District Bondco LLC, 4,943 %, 1/01/2033		2 143 000	2 147 043	0,19
Fortress CBO Investments Ltd., 2022-FL3, "A", FLR, 7,195 %, 23/02/2039		2 906 500	2 830 341	0,25
GLGU 2023-1A Ltd., "A", FLR, 7,617 %, 20/07/2035		5 000 000	5 049 030	0,45
GMAC Mortgage Corp. Loan Trust, FGIC, 5,805 %, 25/10/2036		63 297	63 037	0,01
GS Mortgage Securities Trust, 2017-GS6, "XA", 1,009 %, 10/05/2050 (i)		19 497 394	519 752	0,05
GS Mortgage Securities Trust, 2017-GS7, "XA", 1,078 %, 10/08/2050 (i)		18 093 347	516 362	0,05
Hartwick Park CLO Ltd., 2023-1A, "A", FLR, 6,97 %, 21/01/2036		5 000 000	4 999 195	0,44

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
IMPAC CMB Trust, FLR, 6,19 %, 25/11/2034	USD	14 673	14 302	0,00
IMPAC CMB Trust, FLR, 6,37 %, 25/11/2034		18 866	18 494	0,00
IMPAC Secured Assets Corp., FLR, 6,15 %, 25/05/2036		18 194	16 153	0,00
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp., 0,985 %, 15/09/2050 (i)		18 594 741	444 212	0,04
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "AS", FLR, 7,198 %, 15/07/2036		3 422 000	3 372 263	0,30
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "B", FLR, 7,448 %, 15/07/2036		1 447 000	1 397 518	0,12
Madison Park Funding Ltd., 2014-13A, "BR2", FLR, 7,071 %, 19/04/2030		3 240 360	3 232 528	0,29
Merrill Lynch Mortgage Investors, Inc., 3,999 %, 25/02/2037		795 766	99 821	0,01
MF1 2024-FL14 LLC, "B", FLR, 8,057 %, 19/03/2039		2 404 060	2 398 050	0,21
MF1 2020-FL4 Ltd., "B", FLR, 8,196 %, 15/11/2035		5 144 500	5 130 672	0,45
MF1 2021-FL5 Ltd., "B", FLR, 6,896 %, 15/07/2036		5 771 500	5 660 624	0,50
MF1 2021-FL5 Ltd., "C", FLR, 7,146 %, 15/07/2036		1 641 500	1 576 825	0,14
MF1 2021-FL6 Ltd., "B", FLR, 7,099 %, 16/07/2036		4 288 675	4 167 251	0,37
MF1 2022-FL8 Ltd., "C", FLR, 7,536 %, 19/02/2037		1 570 086	1 508 151	0,13
MF1 2023-FL12 LLC, FLR, "A", 7,401 %, 19/10/2038		5 625 500	5 635 072	0,50
MF1 2024-FL14 LLC, "AS", FLR, 7,658 %, 19/03/2039		3 345 774	3 337 410	0,30
MF1 2024-FL14 LLC, "C", FLR, 8,657 %, 19/03/2039		1 553 848	1 549 963	0,14
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, 2017-C33, "XA", 1,248 %, 15/05/2050 (i)		16 933 353	486 097	0,04
Morgan Stanley Capital I Trust, 2017-H1, "XA", 1,305 %, 15/06/2050 (i)		8 322 661	221 722	0,02
Morgan Stanley Capital I Trust, 2018-H4, "XA", 0,806 %, 15/12/2051 (i)		20 722 521	669 022	0,06
Neuberger Berman CLO Ltd., 2023-53A, "B", FLR, 7,589 %, 24/10/2032		4 712 044	4 719 701	0,42
OBX Trust, 2024-NQM1, "A1", 5,928 %, 25/11/2063		1 977 047	1 987 609	0,18
OBX Trust, 2024-NQM2, "A1", 5,878 %, 25/12/2063		7 795 208	7 809 333	0,69
OneMain Financial Issuance Trust, 2020-2A, "A", 1,75 %, 14/09/2035		2 503 000	2 318 870	0,21
OneMain Financial Issuance Trust, 2022-S1, "A", 4,13 %, 14/05/2035		1 609 000	1 568 012	0,14
Onslow Bay Financial LLC OBX Trust, 2024-NQM1, "A2", 6,253 %, 25/11/2063		411 912	414 469	0,04
Onslow Bay Financial LLC OBX Trust, 2024-NQM2, "A2", 6,03 %, 25/12/2063		4 000 000	3 999 288	0,35
PFP III 2021-7 Ltd., "C", FLR, 7,102 %, 14/04/2038		64 164	62 572	0,01
PFP III 2021-8 Ltd., "B", FLR, 6,952 %, 9/08/2037		1 217 500	1 173 694	0,10
Progress Residential 2021-SFR1 Trust, "B", 1,303 %, 17/04/2038		542 000	496 301	0,04
Progress Residential 2021-SFR1 Trust, "C", 1,555 %, 17/04/2038		406 000	371 872	0,03
Shackleton 2013-4RA CLO Ltd., "B", FLR, 7,475 %, 13/04/2031		1 081 641	1 062 973	0,09
Shelter Growth CRE 2021-FL3 Ltd., "C", FLR, 7,598 %, 15/09/2036		1 280 500	1 225 553	0,11
Southwick Park CLO, Ltd., 2019-4A, "B1R", FLR, 7,079 %, 20/07/2032		1 726 000	1 719 127	0,15
Southwick Park CLO, Ltd., 2019-4A, "B2R", 2,46 %, 20/07/2032		3 000 000	2 653 191	0,24
Southwick Park CLO, Ltd., 2019-4A, "CR", FLR, 7,529 %, 20/07/2032		3 467 000	3 458 752	0,31
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "B", FLR, 7,249 %, 18/04/2038		3 598 000	3 398 572	0,30
Thornburg Mortgage Securities Trust, FLR, 6,13 %, 25/04/2043		1 060	1 058	0,00
TPG Real Estate Finance, 2021-FL4, "AS", FLR, 6,846 %, 15/03/2038		2 633 000	2 560 693	0,23
TPG Real Estate Finance, 2021-FL4, "B", FLR, 7,296 %, 15/03/2038		5 510 000	5 330 451	0,47
UBS Commercial Mortgage Trust, 2017-C1, "XA", 1,012 %, 15/11/2050 (i)		11 528 718	323 370	0,03
UBS Commercial Mortgage Trust, 2018-C14, "XA", 0,867 %, 15/12/2051 (i)		8 905 141	292 107	0,03
Verus Securitization Trust, 2014-1, "A1", 5,712 %, 25/01/2069		3 706 600	3 703 894	0,33
Verus Securitization Trust, 2024-1, "A2", 5,915 %, 25/01/2069		1 677 816	1 676 549	0,15
Westlake Automobile Receivables Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 6,196 %, 15/06/2026		525 636	526 040	0,05
World Omni Select Auto Trust 2023-A, "A2B", FLR, 6,196 %, 15/03/2027		1 931 033	1 933 114	0,17
			189 369 969	16,80
Industrie automobile				
Daimler Trucks Finance North America LLC, 5,2 %, 17/01/2025		2 503 000	2 502 467	0,22
Ford Motor Credit Co. LLC, 5,8 %, 5/03/2027		2 276 000	2 290 539	0,20
Hyundai Capital America, 5,875 %, 7/04/2025		3 369 000	3 386 526	0,30
LKQ Corp., 5,75 %, 15/06/2028		4 260 000	4 347 137	0,38
Stellantis Finance US, Inc., 1,711 %, 29/01/2027		4 914 000	4 503 271	0,40
Volkswagen Group of America Finance LLC, 2,85 %, 26/09/2024		1 909 000	1 875 466	0,17

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Industrie automobile, suite				
Volkswagen Group of America Finance LLC, 3,35 %, 13/05/2025	USD	3 420 000	3 337 727	0,30
Volkswagen Group of America Finance LLC, 1,25 %, 24/11/2025		2 657 000	2 477 505	0,22
			24 720 638	2,19
Radio-télévision				
WarnerMedia Holdings, Inc., 6,412 %, 15/03/2026		3 147 000	3 147 477	0,28
WarnerMedia Holdings, Inc., 3,755 %, 15/03/2027		3 458 000	3 321 877	0,29
			6 469 354	0,57
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Brookfield Finance, Inc., 3,9 %, 25/01/2028		4 943 000	4 781 885	0,42
Charles Schwab Corp., 5,875 %, 24/08/2026		3 547 000	3 631 663	0,32
Charles Schwab Corp., 5,643 % jusqu'au 19/05/2028, FLR jusqu'au 19/05/2029		4 741 000	4 850 767	0,43
LPL Holdings, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		3 951 000	3 804 478	0,34
LPL Holdings, Inc., 6,75 %, 17/11/2028		685 000	720 154	0,06
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		3 852 000	3 550 076	0,32
			21 339 023	1,89
Services aux entreprises				
Equinix, Inc., 1,25 %, 15/07/2025		3 208 000	3 034 635	0,27
Global Payments, Inc., 1,2 %, 1/03/2026		7 166 000	6 620 172	0,59
Tencent Holdings Ltd., 1,81 %, 26/01/2026		3 188 000	2 999 442	0,26
			12 654 249	1,12
Télévision par câble				
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 6,15 %, 10/11/2026		4 320 000	4 412 819	0,39
Cox Communications, Inc., 5,45 %, 15/09/2028		5 133 000	5 238 136	0,47
			9 650 955	0,86
Logiciels				
Dell International LLC/EMC Corp., 4 %, 15/07/2024		2 975 000	2 952 633	0,26
Logiciels - Systèmes				
VMware, Inc., 1 %, 15/08/2024		2 105 000	2 052 809	0,18
Conglomérats				
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/02/2026		4 517 000	4 565 077	0,40
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		2 839 000	2 880 585	0,26
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,15 %, 15/03/2024		6 336 000	6 323 799	0,56
			13 769 461	1,22
Biens de consommation				
Haleon UK Capital LLC, 3,125 %, 24/03/2025		4 642 000	4 541 484	0,40
Haleon US Capital LLC, 3,375 %, 24/03/2027		3 180 000	3 061 905	0,27
			7 603 389	0,67
Conteneurs				
Berry Global, Inc., 1,57 %, 15/01/2026		1 450 000	1 353 560	0,12
Berry Global, Inc., 1,65 %, 15/01/2027		3 944 000	3 561 777	0,32
Berry Global, Inc., 5,5 %, 15/04/2028		552 000	557 616	0,05
			5 472 953	0,49
Équipements électriques				
Arrow Electronics, Inc., 6,125 %, 1/03/2026		6 428 000	6 430 713	0,57
Électronique				
Microchip Technology, Inc., 0,983 %, 1/09/2024		5 706 000	5 554 561	0,49
Qorvo, Inc., 1,75 %, 15/12/2024		1 182 000	1 140 001	0,10
SK hynix, Inc., 6,25 %, 17/01/2026		3 376 000	3 416 064	0,31
			10 110 626	0,90
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
DAE Funding LLC (Émirats arabes unis), 1,55 %, 1/08/2024		1 569 000	1 528 605	0,13
DAE Funding LLC (Émirats arabes unis), 2,625 %, 20/03/2025		781 000	749 534	0,07
			2 278 139	0,20

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Énergie - Sociétés indépendantes				
EQT Corp., 5,7 %, 1/04/2028	USD	4 387 000	4 463 079	0,40
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,15 %, 15/02/2024		6 545 000	6 537 930	0,58
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 6,45 %, 15/04/2027		2 103 000	2 175 914	0,19
Air Lease Corp., 2,2 %, 15/01/2027		2 850 000	2 617 525	0,23
Avolon Holdings Funding Ltd., 5,5 %, 15/01/2026		1 929 000	1 917 533	0,17
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,25 %, 15/04/2026		1 689 000	1 633 493	0,15
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,528 %, 18/11/2027		2 711 000	2 419 613	0,21
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21/02/2028		2 074 000	1 856 310	0,17
			19 158 318	1,70
Alimentation et boissons				
Bacardi-Martini B.V., 5,25 %, 15/01/2029		6 619 000	6 646 367	0,59
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3 %, 2/02/2029		5 744 000	5 079 964	0,45
JDE Peet's N.V., 0,8 %, 24/09/2024		4 581 000	4 431 101	0,39
JDE Peet's N.V., 1,375 %, 15/01/2027		2 836 000	2 555 313	0,23
			18 712 745	1,66
Magasins d'alimentation et pharmacies				
7-Eleven, Inc., 0,8 %, 10/02/2024		3 537 000	3 530 997	0,31
Jeux et hôtellerie				
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc., 5,25 %, 1/06/2025		2 837 000	2 824 263	0,25
Hyatt Hotels Corp., 1,8 %, 1/10/2024		3 063 000	2 984 951	0,26
Hyatt Hotels Corp., 5,75 %, 30/01/2027		1 948 000	1 992 496	0,18
Las Vegas Sands Corp., 3,2 %, 8/08/2024		2 715 000	2 675 993	0,24
Marriott International, Inc., 3,75 %, 1/10/2025		2 905 000	2 844 524	0,25
Marriott International, Inc., 4,9 %, 15/04/2029		2 128 000	2 141 063	0,19
Sands China Ltd., 4,05 %, 8/01/2026		3 120 000	3 004 175	0,27
			18 467 465	1,64
Industrie				
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,516 %, 1/10/2025		274 000	264 238	0,02
Assurances				
Corebridge Global Funding, 5,2 %, 12/01/2029		1 825 000	1 831 984	0,16
Equitable Financial Life Insurance Co., 1,4 %, 7/07/2025		5 141 000	4 866 098	0,43
Equitable Financial Life Insurance Co., 5,5 %, 2/12/2025		2 285 000	2 292 084	0,21
			8 990 166	0,80
Assurances IARD				
Ambac Assurance Corp., 5,1 %, 7/06/2172		9 098	11 873	0,00
Obligations quasi souveraines du marché international				
NBN Co. Ltd. (Commonwealth d'Australie), 5,75 %, 6/10/2028		4 383 000	4 559 776	0,40
Machines et outils				
CNH Industrial Capital LLC, 1,875 %, 15/01/2026		1 450 000	1 365 370	0,12
Grandes banques				
Bank of America Corp., 4,2 %, 26/08/2024		2 207 000	2 188 968	0,19
Bank of America Corp., 4,45 %, 3/03/2026		3 491 000	3 459 368	0,31
Bank of America Corp., 4,25 %, 22/10/2026		2 032 000	2 004 841	0,18
Bank of America Corp., 1,734 % jusqu'au 22/07/2026, FLR jusqu'au 22/07/2027		10 523 000	9 699 378	0,86
Bank of America Corp., 4,183 %, 25/11/2027		3 390 000	3 308 514	0,29
Barclays PLC, 2,852 % jusqu'au 7/05/2025, FLR jusqu'au 7/05/2026		1 327 000	1 284 554	0,11
Barclays PLC, 2,279 % jusqu'au 24/11/2026, FLR jusqu'au 24/11/2027		4 530 000	4 167 911	0,37
BNP Paribas S.A., 2,591 % jusqu'au 20/01/2027, FLR jusqu'au 20/01/2028		4 550 000	4 223 908	0,38
Capital One Financial Corp., 2,636 % jusqu'au 3/03/2025, FLR jusqu'au 3/03/2026		6 783 000	6 559 302	0,58
Capital One Financial Corp., 7,149 % jusqu'au 29/10/2026, FLR jusqu'au 29/10/2027		1 723 000	1 795 573	0,16
Credit Agricole S.A., 1,907 % jusqu'au 16/06/2025, FLR jusqu'au 16/06/2026		4 044 000	3 854 742	0,34
Credit Agricole S.A., 5,335 % jusqu'au 10/01/2029, FLR jusqu'au 10/01/2030		4 554 000	4 573 350	0,41
Deutsche Bank AG, 0,898 %, 28/05/2024		1 427 000	1 405 518	0,13
Deutsche Bank AG, 1,447 % jusqu'au 1/04/2024, FLR jusqu'au 1/04/2025		6 373 000	6 321 039	0,56

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Grandes banques, suite				
Deutsche Bank AG, 7,146 % jusqu'au 13/07/2026, FLR jusqu'au 13/07/2027	USD	1 702 000	1 762 797	0,16
Deutsche Bank AG, 2,311 % jusqu'au 16/11/2026, FLR jusqu'au 16/11/2027		1 501 000	1 373 475	0,12
Deutsche Bank AG, 6,72 % jusqu'au 18/01/2028, FLR jusqu'au 18/01/2029		192 000	199 893	0,02
Goldman Sachs Group, Inc., 3,5 %, 1/04/2025		2 652 000	2 601 837	0,23
Goldman Sachs Group, Inc., 1,093 % jusqu'au 9/12/2025, FLR jusqu'au 9/12/2026		2 415 000	2 241 645	0,20
Goldman Sachs Group, Inc., 5,95 %, 15/01/2027		3 767 000	3 885 888	0,35
HSBC Holdings PLC, 2,099 % jusqu'au 4/06/2025, FLR jusqu'au 4/06/2026		2 157 000	2 062 569	0,18
HSBC Holdings PLC, 1,589 % jusqu'au 24/05/2026, FLR jusqu'au 24/05/2027		1 869 000	1 719 334	0,15
HSBC Holdings PLC, 2,251 % jusqu'au 22/11/2026, FLR jusqu'au 22/11/2027		4 729 000	4 357 194	0,39
Huntington Bancshares, Inc., 4,008 % jusqu'au 16/05/2024, FLR jusqu'au 16/05/2025		1 679 000	1 663 742	0,15
Huntington Bancshares, Inc., 5,699 % jusqu'au 18/11/2024, FLR jusqu'au 18/11/2025		3 916 000	3 894 893	0,35
Huntington Bancshares, Inc., 4,443 % jusqu'au 4/08/2027, FLR jusqu'au 4/08/2028		459 000	446 076	0,04
Huntington Bancshares, Inc., 6,208 % jusqu'au 21/08/2028, FLR jusqu'au 21/08/2029		2 028 000	2 096 065	0,19
JPMorgan Chase & Co., 5,546 % jusqu'au 15/12/2024, FLR jusqu'au 15/12/2025		6 965 000	6 968 907	0,62
JPMorgan Chase & Co., 2,005 % jusqu'au 13/03/2025, FLR jusqu'au 13/03/2026		4 299 000	4 139 185	0,37
JPMorgan Chase & Co., 1,04 % jusqu'au 4/02/2026, FLR jusqu'au 4/02/2027		3 442 000	3 177 770	0,28
JPMorgan Chase & Co., 1,578 % jusqu'au 22/04/2026, FLR jusqu'au 22/04/2027		2 701 000	2 507 045	0,22
JPMorgan Chase & Co., 4,25 %, 1/10/2027		2 842 000	2 806 191	0,25
JPMorgan Chase & Co., 5,04 % jusqu'au 23/01/2027, FLR jusqu'au 23/01/2028		2 701 000	2 712 553	0,24
Lloyds Banking Group PLC, 3,511 % jusqu'au 18/03/2025, FLR jusqu'au 18/03/2026		7 715 000	7 540 553	0,67
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0,953 % jusqu'au 19/07/2025, FLR jusqu'au 19/07/2025		1 632 000	1 596 664	0,14
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0,962 % jusqu'au 11/10/2024, FLR jusqu'au 11/10/2025		1 078 000	1 043 643	0,09
Morgan Stanley, 4,35 %, 8/09/2026		6 080 000	5 988 901	0,53
Morgan Stanley, 3,625 %, 20/01/2027		980 000	952 998	0,08
Morgan Stanley, 3,95 %, 23/04/2027		2 225 000	2 165 342	0,19
Morgan Stanley, 1,512 % jusqu'au 20/07/2036, FLR jusqu'au 20/07/2027		1 193 000	1 094 928	0,10
Nationwide Construction Society, 2,972 % jusqu'au 16/02/2027, FLR jusqu'au 16/02/2028		5 748 000	5 348 412	0,47
NatWest Group PLC, 4,269 % jusqu'au 22/03/2024, FLR jusqu'au 22/03/2025		6 040 000	6 025 383	0,53
PNC Financial Services Group, Inc., 5,354 % jusqu'au 2/12/2027, FLR jusqu'au 2/12/2028		5 469 000	5 538 451	0,49
Standard Chartered PLC, 1,214 % jusqu'au 23/03/2024, FLR jusqu'au 23/03/2025		1 562 000	1 549 863	0,14
Standard Chartered PLC, 1,822 % jusqu'au 23/11/2024, FLR jusqu'au 23/11/2025		1 631 000	1 578 134	0,14
Standard Chartered PLC, 6,17 % jusqu'au 9/01/2026, FLR jusqu'au 9/01/2027		1 041 000	1 058 006	0,09
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1,474 %, 8/07/2025		3 938 000	3 743 664	0,33
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 2,174 %, 14/01/2027		2 831 000	2 627 076	0,23
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0,85 %, 25/03/2024		2 670 000	2 652 102	0,24
Toronto-Dominion Bank, 5,532 %, 17/07/2026		7 458 000	7 591 932	0,67
UBS Group AG, 5,711 % jusqu'au 12/01/2026, FLR jusqu'au 12/01/2027		3 105 000	3 123 477	0,28
UBS Group AG, 4,703 % jusqu'au 5/08/2026, FLR jusqu'au 5/08/2027		3 112 000	3 073 423	0,27
UBS Group AG, 9,25 % jusqu'au 13/11/2028, FLR jusqu'au 13/05/2172		845 000	903 887	0,08
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026		956 000	905 656	0,08
Wells Fargo & Co., 2,164 % jusqu'au 11/02/2025, FLR jusqu'au 11/02/2026		5 000 000	4 830 986	0,43
Wells Fargo & Co., 3,526 % jusqu'au 24/03/2027, FLR jusqu'au 24/03/2028		1 843 000	1 766 333	0,16
			178 163 839	15,81
Technologies et services médicaux et de santé				
IQVIA, Inc., 5,7 %, 15/05/2028		1 221 000	1 243 461	0,11
IQVIA, Inc., 6,25 %, 1/02/2029		1 175 000	1 222 841	0,11
Thermo Fisher Scientific, Inc., 1,215 %, 18/10/2024		5 624 000	5 464 869	0,48
			7 931 171	0,70
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 4,75 %, 10/04/2027		7 038 000	6 956 698	0,62
Glencore Funding LLC, 4,125 %, 12/03/2024		2 358 000	2 354 008	0,21
Glencore Funding LLC, 1,625 %, 1/09/2025		3 620 000	3 432 835	0,30
Glencore Funding LLC, 1,625 %, 27/04/2026		2 986 000	2 774 798	0,25
			15 518 339	1,38

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS **au 31 janvier 2024**
MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Secteur intermédiaire				
Columbia Pipelines Holdings Co. LLC, 6,055 %, 15/08/2026	USD	5 831 000	5 961 987	0,53
DCP Midstream Operating, LP, 5,625 %, 15/07/2027		6 986 000	7 118 280	0,63
Enbridge, Inc., 2,5 %, 14/02/2025		989 000	961 809	0,08
Enbridge, Inc., 5,969 %, 8/03/2026		2 891 000	2 890 872	0,26
Energy Transfer LP, 2,9 %, 15/05/2025		1 716 000	1 665 755	0,15
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028		1 478 000	1 504 008	0,13
Plains All American Pipeline LP, 4,65 %, 15/10/2025		3 867 000	3 837 983	0,34
Transcanada Pipelines Ltd., 6,203 %, 9/03/2026		1 803 000	1 802 866	0,16
Western Midstream Operating LP, 3,1 %, 1/02/2025		1 845 000	1 797 841	0,16
			27 541 401	2,44
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 4,5 %, 1/06/2024		1 173	1 165	0,00
Fannie Mae, 3 %, 1/12/2031		591 226	567 111	0,05
Fannie Mae, 2 %, 25/05/2044		111 079	108 589	0,01
Freddie Mac, 1,087 %, 25/04/2024 (i)		68 995	54	0,00
Freddie Mac, 5,978 %, 25/07/2029		3 597 108	3 593 580	0,32
Freddie Mac, 3 %, 15/04/2033–15/06/2045		3 655 657	3 459 496	0,31
Freddie Mac, 2 %, 15/07/2042		491 612	451 121	0,04
			8 181 116	0,73
Obligations municipales				
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,156 %, 1/07/2024		490 000	483 757	0,04
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,306 %, 1/07/2025		385 000	371 870	0,03
Massachusetts Educational Financing Authority, Education Loan Rev., Taxable, "A", 2,562 %, 1/07/2026		495 000	472 107	0,04
Michigan Finance Authority Tobacco Settlement Asset-Backed Rev., Taxable (2006 Recettes vendues de tabac), "A-1", 2,326 %, 1/06/2030		514 989	506 304	0,05
New Jersey Transports Trust Fund Authority, Système de transport, Taxable, "B", 2,631 %, 15/06/2024		790 000	781 086	0,07
			2 615 124	0,23
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 4,2 %, 23/03/2025		6 600 000	6 509 803	0,58
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
AIB Group PLC, 7,583 % jusqu'au 14/10/2025, FLR jusqu'au 14/10/2026		5 845 000	6 032 271	0,53
AIB Group PLC, 6,608 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2029		737 000	774 259	0,07
American Express Co., 2,25 %, 4/03/2025		1 954 000	1 893 649	0,17
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 0,65 %, 27/02/2024		5 737 000	5 717 744	0,51
Banque Federative du Credit Mutuel S.A., 5,896 %, 13/07/2026		2 973 000	3 035 224	0,27
Citizens Financial Group, Inc., 5,841 % jusqu'au 23/01/2029, FLR jusqu'au 23/01/2030		2 743 000	2 762 056	0,24
Macquarie Group Ltd., 1,201 % jusqu'au 14/10/2024, FLR jusqu'au 14/10/2025		1 750 000	1 696 147	0,15
Macquarie Group Ltd., 1,34 % jusqu'au 12/01/2026, FLR jusqu'au 12/01/2027		3 440 000	3 175 716	0,28
Truist Financial Corp., 5,435 % jusqu'au 24/01/2029, FLR jusqu'au 24/01/2030		3 314 000	3 342 245	0,30
			28 429 311	2,52
Produits pharmaceutiques				
Amgen, Inc., 5,507 %, 2/03/2026		3 402 000	3 402 572	0,30
Bayer US Finance LLC, 6,125 %, 21/11/2026		1 154 000	1 171 383	0,11
Bayer US Finance LLC, 6,25 %, 21/01/2029		1 110 000	1 135 210	0,10
			5 709 165	0,51
Chemins de fer et transport maritime				
Canadian Pacific Railway Co., 1,35 %, 2/12/2024		4 488 000	4 340 371	0,39
Immobilier - Bureaux				
Corporate Office Property LP, REIT, 2,25 %, 15/03/2026		4 144 000	3 893 143	0,35
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		803 000	674 662	0,06
			4 567 805	0,41

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Immobilier - Autres				
Sun Communities Operating LP, 5,5 %, 15/01/2029	USD	2 729 000	2 755 077	0,24
Distribution				
Nordstrom, Inc., 2,3 %, 8/04/2024		1 350 000	1 336 500	0,12
Produits chimiques spéciaux				
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,23 %, 1/10/2025		5 741 000	5 349 930	0,48
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027		1 824 000	1 616 170	0,14
			6 966 100	0,62
Magasins spécialisés				
Genuine Parts Co., 1,75 %, 1/02/2025		4 527 000	4 374 435	0,39
Télécommunications mobiles				
Crown Castle, Inc., REIT, 1,35 %, 15/07/2025		1 045 000	988 812	0,09
Crown Castle, Inc., REIT, 2,9 %, 15/03/2027		596 000	558 914	0,05
Rogers Communications, Inc., 3,2 %, 15/03/2027		5 274 000	5 041 137	0,45
T-Mobile USA, Inc., 3,5 %, 15/04/2025		6 669 000	6 538 251	0,58
			13 127 114	1,17
Tabac				
B.A.T. International Finance PLC, 5,931 %, 2/02/2029		2 929 000	3 040 641	0,27
Imperial Brands Finance PLC, 6,125 %, 27/07/2027		697 000	716 451	0,06
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 15/11/2024		2 267 000	2 264 389	0,20
Philip Morris International, Inc., 5 %, 17/11/2025		1 029 000	1 034 010	0,09
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 17/11/2027		2 390 000	2 429 121	0,22
Philip Morris International, Inc., 4,875 %, 15/02/2028		2 217 000	2 235 367	0,20
			11 719 979	1,04
Transports - Services				
Element Fleet Management Corp., 1,6 %, 6/04/2024		6 954 000	6 897 282	0,61
Element Fleet Management Corp., 6,271 %, 26/06/2026		8 788 000	8 946 834	0,79
ERAC USA Finance LLC, 3,85 %, 15/11/2024		1 128 000	1 113 722	0,10
ERAC USA Finance LLC, 3,8 %, 1/11/2025		1 128 000	1 103 461	0,10
Penske Truck Leasing Co. LP, 5,35 %, 12/01/2027		2 133 000	2 145 249	0,19
			20 206 548	1,79
Obligations du Trésor américain				
Bons du Trésor américain, 2,75 %, 15/05/2025		50 700 000	49 590 938	4,40
Bons du Trésor américain, 5 %, 30/09/2025		144 878 000	146 372 054	12,98
Bons du Trésor américain, 4,5 %, 15/07/2026		47 768 000	48 213 959	4,28
Bons du Trésor américain, 4,625 %, 15/11/2026		78 500 000	79 702 031	7,07
			323 878 982	28,73
Services publics - Énergie électrique				
American Electric Power Co., Inc., 5,699 %, 15/08/2025		1 817 000	1 830 973	0,16
Edison International, 4,7 %, 15/08/2025		1 864 000	1 847 542	0,16
Emera US Finance LP, 0,833 %, 15/06/2024		1 500 000	1 470 387	0,13
Enel Finance International N.V., 6,8 %, 14/10/2025		7 423 000	7 610 511	0,67
Entergy Louisiana LLC, 0,95 %, 1/10/2024		8 551 000	8 317 062	0,74
FirstEnergy Corp., 2,05 %, 1/03/2025		2 796 000	2 683 657	0,24
FirstEnergy Corp., 1,6 %, 15/01/2026		1 413 000	1 314 782	0,12
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 6,051 %, 1/03/2025		2 343 000	2 362 749	0,21
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 5,749 %, 1/09/2025		5 693 000	5 750 489	0,51
Pacific Gas & Electric Co., 4,95 %, 8/06/2025		1 500 000	1 492 604	0,13
Pacific Gas & Electric Co., 6,1 %, 15/01/2029		2 233 000	2 313 494	0,21
WEC Energy Group, Inc., 0,8 %, 15/03/2024		1 592 000	1 582 131	0,14
			38 576 381	3,42
Total des obligations (coût identifié, 1 130 995 826 \$)			1 111 847 441	98,64

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Limited Maturity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)			
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 1 369 000 \$)	USD 1 369 000	1 368 802	0,12
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 1 132 364 826 \$) (k)		1 113 216 243	98,76
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		13 959 264	1,24
ACTIF NET		1 127 175 507	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
General Dynamics Corp.	383	101 491	0,73
Honeywell International, Inc.	355	71 802	0,51
Howmet Aerospace, Inc.	521	29 312	0,21
MTU Aero Engines Holding AG	106	24 480	0,18
Northrop Grumman Corp.	200	89 352	0,64
Rolls-Royce Holdings PLC	13 359	50 772	0,36
RTX Corp.	983	89 571	0,64
		456 780	3,27
Compagnies aériennes			
Ryanair Holdings PLC, ADR	504	67 334	0,48
Boissons alcoolisées			
Carlsberg A.S., "B"	314	40 386	0,29
Diageo PLC	2 890	103 944	0,74
Pernod Ricard S.A.	321	52 831	0,38
		197 161	1,41
Industrie de la confection			
Compagnie Financière Richemont S.A.	563	84 162	0,60
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	163	135 567	0,97
		219 729	1,57
Industrie automobile			
Compagnie Generale des Etablissements Michelin	932	31 042	0,22
DENSO Corp.	3 400	53 212	0,38
		84 254	0,60
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
BlackRock, Inc.	61	47 233	0,34
Citigroup, Inc.	1 063	59 709	0,43
CME Group, Inc.	94	19 349	0,14
Deutsche Boerse AG	367	73 275	0,52
KKR & Co., Inc.	612	52 987	0,38
London Stock Exchange Group PLC	484	54 779	0,39
NASDAQ, Inc.	1 069	61 756	0,44
		369 088	2,64
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	250	90 970	0,65
Compass Group PLC	3 376	93 184	0,67
CoStar Group, Inc.	556	46 415	0,33
Equifax, Inc.	173	42 271	0,30
Experian PLC	1 973	82 256	0,59
MSCI, Inc.	117	70 038	0,50
Randstad Holding N.V.	160	9 072	0,07

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Services aux entreprises, suite			
Tata Consultancy Services Ltd.	617	28 352	0,20
TransUnion	196	13 561	0,10
Verisk Analytics, Inc., "A"	298	71 976	0,52
		548 095	3,93
Télévision par câble			
Charter Communications, Inc., "A"	75	27 803	0,20
Comcast Corp., "A"	2 452	114 116	0,82
		141 919	1,02
Produits chimiques			
PPG Industries, Inc.	212	29 901	0,21
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	64	39 538	0,28
Cadence Design Systems, Inc.	272	78 461	0,56
Check Point Software Technologies Ltd.	256	40 686	0,29
Dassault Systemes SE	537	27 993	0,20
Datadog, Inc., "A"	87	10 826	0,08
Intuit, Inc.	86	54 294	0,39
Microsoft Corp.	1 617	642 887	4,61
SAP SE	647	112 597	0,81
Synopsys, Inc.	134	71 469	0,51
		1 078 751	7,73
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	615	42 990	0,31
Apple, Inc.	1 284	236 769	1,69
Cap Gemini S.A.	441	98 749	0,71
Hitachi Ltd.	1 100	86 406	0,62
Samsung Electronics Co. Ltd.	688	37 307	0,27
ServiceNow, Inc.	104	79 602	0,57
Sony Group Corp.	700	69 163	0,49
		650 986	4,66
Construction			
Compagnie de Saint-Gobain S.A.	756	53 536	0,39
Martin Marietta Materials, Inc.	33	16 778	0,12
Otis Worldwide Corp.	162	14 327	0,10
Sherwin-Williams Co.	182	55 397	0,40
Vulcan Materials Co.	341	77 069	0,55
		217 107	1,56
Biens de consommation			
Beiersdorf AG	580	85 207	0,61
Colgate-Palmolive Co.	138	11 620	0,08
Estée Lauder Cos., Inc., "A"	136	17 951	0,13
Kenvue, Inc.	2 211	45 900	0,33
Kimberly-Clark Corp.	248	30 000	0,21
KOSE Corp.	300	19 770	0,14
L'Oréal S.A.	19	9 111	0,07
Reckitt Benckiser Group PLC	196	14 154	0,10
		233 713	1,67
Services de consommation			
Uber Technologies, Inc.	644	42 034	0,30
Équipements électriques			
AMETEK, Inc.	314	50 884	0,36
Amphenol Corp., "A"	397	40 137	0,29
Johnson Controls International PLC	476	25 080	0,18
Legrand S.A.	388	37 729	0,27
Mitsubishi Electric Corp.	2 800	41 234	0,29

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Équipements électriques, suite			
Rockwell Automation, Inc.	75	18 996	0,14
Schneider Electric SE	638	125 742	0,90
		339 802	2,43
Électronique			
Analog Devices, Inc.	422	81 176	0,58
Applied Materials, Inc.	109	17 909	0,13
ASML Holding N.V., ADR	92	80 023	0,57
Hoya Corp.	200	25 369	0,18
KLA Corp.	173	102 769	0,74
Kyocera Corp.	3 400	49 824	0,36
Lam Research Corp.	48	39 608	0,28
Marvell Technology, Inc.	159	10 764	0,08
NVIDIA Corp.	502	308 866	2,21
NXP Semiconductors N.V.	219	46 115	0,33
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	723	81 670	0,59
Texas Instruments, Inc.	367	58 764	0,42
		902 857	6,47
Énergie - Sociétés indépendantes			
ConocoPhillips	977	109 297	0,78
EOG Resources, Inc.	310	35 275	0,25
Pioneer Natural Resources Co.	278	63 893	0,46
		208 465	1,49
Énergie - Sociétés intégrées			
Chevron Corp.	251	37 005	0,27
Eni S.p.A.	3 232	51 694	0,37
Galp Energia SGPS S.A., "B"	2 078	32 589	0,23
Suncor Energy, Inc.	1 085	35 929	0,26
		157 217	1,13
Divertissement			
Spotify Technology S.A.	145	31 226	0,22
Alimentation et boissons			
Mondelez International, Inc.	138	10 387	0,08
Nestlé S.A.	1 694	193 148	1,38
PepsiCo, Inc.	310	52 244	0,37
		255 779	1,83
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Seven & I Holdings Co. Ltd.	900	35 809	0,26
Tesco PLC	9 732	35 309	0,25
		71 118	0,51
Jeux et hôtellerie			
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	260	49 649	0,36
Las Vegas Sands Corp.	179	8 757	0,06
Marriott International, Inc., "A"	270	64 727	0,46
		123 133	0,88
Organisations de soins de santé intégrés			
Cigna Group	398	119 778	0,86
Elevance Health, Inc.	69	34 047	0,24
		153 825	1,10
Assurances			
AIA Group Ltd.	8 400	65 315	0,47
Aon PLC	316	94 304	0,67
Arthur J. Gallagher & Co.	113	26 234	0,19
Chubb Ltd.	347	85 015	0,61
Intact Financial Corp.	192	30 026	0,21
Marsh & McLennan Cos., Inc.	553	107 194	0,77

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Assurances, suite			
Progressive Corp.	738	131 548	0,94
Prudential PLC	2 768	28 520	0,20
Travelers Cos., Inc.	361	76 301	0,55
Zurich Insurance Group AG	123	62 587	0,45
		707 044	5,06
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	1 903	266 610	1,91
Alphabet, Inc., "C"	498	70 617	0,51
Gartner, Inc.	80	36 595	0,26
Meta Platforms, Inc., "A"	552	215 357	1,54
NetEase, Inc.	1 500	29 283	0,21
Tencent Holdings Ltd.	1 000	34 780	0,25
		653 242	4,68
Loisirs et jouets			
Take-Two Interactive Software, Inc.	128	21 111	0,15
Machines et outils			
Daikin Industries Ltd.	400	64 295	0,46
Eaton Corp. PLC	495	121 810	0,87
Illinois Tool Works, Inc.	198	51 658	0,37
Kubota Corp.	1 100	16 702	0,12
PACCAR, Inc.	291	29 213	0,21
SMC Corp.	100	55 650	0,40
Trane Technologies PLC	141	35 539	0,26
Veralto Corp.	26	1 994	0,01
		376 861	2,70
Grandes banques			
DBS Group Holdings Ltd.	2 000	47 356	0,34
ING Groep N.V.	4 251	60 465	0,43
JPMorgan Chase & Co.	1 094	190 750	1,37
Morgan Stanley	886	77 294	0,55
PNC Financial Services Group, Inc.	303	45 816	0,33
Toronto-Dominion Bank	717	43 555	0,31
UBS Group AG	2 650	79 147	0,57
		544 383	3,90
Technologies et services médicaux et de santé			
ICON PLC	52	13 565	0,10
McKesson Corp.	204	101 977	0,73
Veeva Systems, Inc.	60	12 445	0,09
		127 987	0,92
Équipements médicaux			
Abbott Laboratories	396	44 808	0,32
Agilent Technologies, Inc.	113	14 701	0,11
Boston Scientific Corp.	1 878	118 802	0,85
EssilorLuxottica	342	67 240	0,48
Medtronic PLC	277	24 249	0,17
Olympus Corp.	2 900	42 965	0,31
QIAGEN N.V.	893	38 924	0,28
Sonova Holding AG	113	36 060	0,26
STERIS PLC	73	15 983	0,11
Terumo Corp.	1 100	37 133	0,27
Thermo Fisher Scientific, Inc.	101	54 437	0,39
		495 302	3,55
Métaux et exploitation minière			
Rio Tinto PLC	539	37 590	0,27

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Gaz naturel - Distribution			
ENGIE S.A.	3 431	54 771	0,39
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
AIB Group PLC	5 285	23 171	0,17
American Express Co.	416	83 508	0,60
HDFC Bank Ltd.	1 722	30 142	0,22
HDFC Bank Ltd., ADR	277	15 371	0,11
Intesa Sanpaolo S.p.A.	19 959	61 754	0,44
Julius Baer Group Ltd.	486	26 541	0,19
KBC Group N.V.	386	25 158	0,18
Mastercard, Inc., "A"	384	172 504	1,23
Moody's Corp.	17	6 665	0,05
Visa, Inc., "A"	528	144 281	1,03
		589 095	4,22
Produits pharmaceutiques			
AbbVie, Inc.	314	51 622	0,37
Argenx SE, ADR	23	8 752	0,06
Bayer AG	581	18 086	0,13
Eli Lilly & Co.	180	116 210	0,83
Johnson & Johnson	595	94 545	0,68
Merck & Co., Inc.	503	60 752	0,43
Merck KGaA	425	69 997	0,50
Novartis AG	648	67 132	0,48
Novo Nordisk A.S., "B"	866	98 906	0,71
Pfizer, Inc.	2 352	63 692	0,46
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	26	24 512	0,18
Roche Holding AG	388	110 858	0,79
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	191	82 776	0,59
Zoetis, Inc.	148	27 796	0,20
		895 636	6,41
Imprimerie et édition			
RELX PLC	1 959	80 984	0,58
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian National Railway Co.	654	81 122	0,58
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	26	2 093	0,01
Union Pacific Corp.	370	90 254	0,65
		173 469	1,24
Immobilier			
Prologis, Inc., REIT	591	74 874	0,54
Public Storage, Inc., REIT	51	14 443	0,10
		89 317	0,64
Restaurants			
Chipotle Mexican Grill, Inc., "A"	6	14 453	0,11
Yum China Holdings, Inc.	449	15 531	0,11
		29 984	0,22
Produits chimiques spéciaux			
Air Liquide S.A.	682	127 833	0,92
Air Products & Chemicals, Inc.	39	9 973	0,07
Akzo Nobel N.V.	89	6 812	0,05
Corteva, Inc.	436	19 829	0,14
DuPont de Nemours, Inc.	795	49 131	0,35
Linde PLC	337	136 428	0,98
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	600	23 644	0,17
Sika AG	113	31 190	0,22
		404 840	2,90

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Managed Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Magasins spécialisés			
Amazon.com, Inc.	1 805	280 136	2,00
Lowe's Cos., Inc.	394	83 859	0,60
Lululemon Athletica, Inc.	39	17 699	0,13
O'Reilly Automotive, Inc.	31	31 714	0,23
Target Corp.	398	55 354	0,40
ZOZO, Inc.	800	17 574	0,12
		486 336	3,48
Services publics - Énergie électrique			
American Electric Power Co., Inc.	248	19 379	0,14
Dominion Energy, Inc.	1 057	48 326	0,35
Duke Energy Corp.	784	75 131	0,54
Exelon Corp.	806	28 057	0,20
PG&E Corp.	1 776	29 961	0,21
Southern Co.	1 071	74 456	0,53
Xcel Energy, Inc.	566	33 886	0,24
		309 196	2,21
Total des actions ordinaires (coût identifié, 10 098 133 \$)		12 657 422	90,63
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)			
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 100 000 \$)	USD 100 000	99 986	0,72
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 10 198 133 \$)		12 757 408	91,35

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
S&P 500 Index – Juin 2024 @ 4 700 \$	484 564	1	8 751	0,06
S&P 500 Index – Septembre 2024 @ 4 200 \$	484 564	1	5 468	0,04
S&P 500 Index – Décembre 2024 @ 4 200 \$	484 564	1	8 338	0,06
Total des options de vente achetées (primes versées, 41 028 \$)			22 557	0,16
Total des investissements (coût identifié, 10 239 161 \$) (k)			12 779 965	91,51
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			1 185 381	8,49
ACTIF NET			13 965 346	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Prudent Capital Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Safran S.A.	314 869	58 962 322	1,75
Thales S.A.	286 524	41 910 660	1,25
		100 872 982	3,00
Boissons alcoolisées			
Heineken Holding N.V.	848 961	71 099 022	2,11
Industrie automobile			
Knorr-Bremse AG	871 874	53 940 695	1,60
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
B3 S.A. - Brasil Bolsa Balcao	9 068 800	23 960 639	0,72

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Prudent Capital Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs, suite			
Euronext N.V.	291 090	25 630 086	0,76
		49 590 725	1,48
Logiciels			
Microsoft Corp.	45 297	18 009 181	0,53
Oracle Corp.	342 226	38 226 644	1,14
Oracle Corp. Japan	531 300	41 868 301	1,24
Sage Group PLC	4 302 589	64 111 722	1,91
		162 215 848	4,82
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	1 021 115	71 379 195	2,12
Samsung Electronics Co. Ltd.	1 397 036	75 753 896	2,25
		147 133 091	4,37
Services de consommation			
Booking Holdings, Inc.	20 179	70 777 237	2,10
Équipements électriques			
Legrand S.A.	572 808	55 699 605	1,66
Électronique			
Kyocera Corp.	3 590 000	52 607 839	1,56
Assurances			
Swiss Re Ltd.	248 512	28 538 779	0,85
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	609 681	85 416 308	2,54
Scout24 AG	786 246	58 245 919	1,73
		143 662 227	4,27
Loisirs et jouets			
Nintendo Co. Ltd.	1 442 400	80 682 152	2,40
Équipements médicaux			
Agilent Technologies, Inc.	202 625	26 361 512	0,78
Bio-Rad Laboratories, Inc., "A"	169 360	54 345 930	1,62
Sonova Holding AG	190 984	60 946 185	1,81
		141 653 627	4,21
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Edenred	267 712	16 033 916	0,48
S&P Global, Inc.	85 969	38 544 201	1,14
		54 578 117	1,62
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	293 461	43 290 069	1,29
Immobilier			
LEG Immobilien SE	1 340 863	111 973 288	3,33
Produits chimiques spéciaux			
Nitto Denko Corp.	572 100	47 374 386	1,41
Magasins spécialisés			
Zalando SE	1 528 789	30 862 397	0,92
Télécommunications mobiles			
KDDI Corp.	1 794 400	59 375 714	1,77
Wireless Infrastructure Italian S.p.A.	3 634 572	44 169 041	1,31
		103 544 755	3,08
Services téléphoniques			
Altice USA, Inc., "A"	1 607 295	3 921 800	0,11
Hellenic Telecommunications Organization S.A.	1 590 796	22 091 380	0,66
		26 013 180	0,77
Transport par camion			
Yamato Holdings Co. Ltd.	2 181 700	37 775 412	1,12

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Prudent Capital Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite				
Services publics - Énergie électrique				
Iberdrola S.A.		4 629 278	55 774 814	1,66
Total des actions ordinaires (coût identifié, 1 492 272 264 \$)			1 669 660 247	49,63
OBLIGATIONS				
Créances adossées à des actifs et titrisées				
LAD Auto Receivables Trust, 2023-2A, "A2", 5,93 %, 15/06/2027	USD	4 265 740	4 273 481	0,13
Toyota Lease Owner Trust, 2023-A, "A2", 5,3 %, 20/08/2025		2 089 910	2 087 811	0,06
			6 361 292	0,19
Industrie automobile				
RAC Bond Co. PLC, 5,25 %, 4/11/2027	GBP	5 972 000	7 004 340	0,21
Radio-télévision				
WMG Acquisition Corp., 3,875 %, 15/07/2030	USD	14 373 000	12 809 936	0,38
Construction				
Foundation Construction Materials LLC, 6 %, 1/03/2029		8 113 000	7 129 299	0,21
Interface, Inc., 5,5 %, 1/12/2028		9 530 000	8 918 555	0,26
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 5,25 %, 15/07/2028		11 805 000	11 342 244	0,34
Standard Industries, Inc., 3,375 %, 15/01/2031		26 121 000	22 211 591	0,66
			49 601 689	1,47
Conglomérats				
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 30/06/2028		6 606 000	6 201 845	0,19
BWX Technologies, Inc., 4,125 %, 15/04/2029		3 682 000	3 410 710	0,10
			9 612 555	0,29
Biens de consommation				
Coty, Inc., 6,5 %, 15/04/2026		2 203 000	2 199 975	0,07
Services de consommation				
Arches Buyer, Inc., 6,125 %, 1/12/2028		19 226 000	16 607 611	0,49
Match Group Holdings II LLC, 4,625 %, 1/06/2028		23 461 000	22 084 309	0,66
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp., 5,75 %, 15/01/2029		17 965 000	13 343 863	0,40
			52 035 783	1,55
Conteneurs				
Can-Pack S.A./Eastern PA Land Investment Holding LLC, 3,875 %, 15/11/2029		17 935 000	15 806 295	0,47
Électronique				
Sensata Technologies B.V., 5 %, 1/10/2025		6 011 000	5 983 799	0,18
Sensata Technologies, Inc., 3,75 %, 15/02/2031		4 783 000	4 152 013	0,12
			10 135 812	0,30
Établissements financiers				
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		15 787 405	15 215 112	0,45
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		10 129 343	9 762 154	0,29
			24 977 266	0,74
Assurances IARD				
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc., 4,25 %, 15/02/2029		5 230 000	4 689 701	0,14
Hub International Ltd., 7,375 %, 31/01/2032		13 704 000	14 034 209	0,42
			18 723 910	0,56
Technologies et services médicaux et de santé				
Charles River Laboratories International, Inc., 4 %, 15/03/2031		16 455 000	14 624 052	0,43
Équipements médicaux				
Teleflex, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		10 079 000	9 777 940	0,29
Zimmer Biomet Holdings, Inc., 1,45 %, 22/11/2024		9 017 000	8 730 247	0,26
			18 508 187	0,55
Secteur intermédiaire				
Peru LNG, 5,375 %, 22/03/2030		18 400 000	15 147 189	0,45
Venture Global LNG, Inc., 8,125 %, 1/06/2028		6 836 000	6 909 068	0,21
Venture Global LNG, Inc., 9,5 %, 1/02/2029		6 884 000	7 311 076	0,22
Venture Global LNG, Inc., 8,375 %, 1/06/2031		12 794 000	12 919 847	0,38
			42 287 180	1,26

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Prudent Capital Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 6,5 %, 1/09/2053–1/10/2053	USD	3 271 933	3 351 830	0,10
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/01/2053–1/06/2053		1 088 215	1 091 541	0,03
Fannie Mae, UMBS, 4,5 %, 1/06/2053		6 600 386	6 381 244	0,19
Freddie Mac, 6,5 %, 1/09/2053		3 273 605	3 350 890	0,10
Freddie Mac, UMBS, 4,5 %, 1/06/2038–1/11/2052		19 519 778	19 084 885	0,57
Freddie Mac, UMBS, 5,5 %, 1/12/2052–1/07/2053		15 747 140	15 799 322	0,47
Freddie Mac, UMBS, 6 %, 1/11/2053		2 297 426	2 334 597	0,07
Ginnie Mae, 5,5 %, 20/02/2053		17 185 130	17 305 784	0,52
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/07/2053		9 035 509	8 794 029	0,26
Ginnie Mae, TBA, 5 %, 20/02/2054–20/03/2054		17 300 000	17 186 358	0,51
Ginnie Mae, TBA, 6 %, 20/02/2054		4 550 000	4 619 398	0,14
Ginnie Mae, TBA, 6,5 %, 20/02/2054–20/03/2054		6 525 000	6 665 955	0,20
UMBS, TBA, 5 %, 18/03/2039–13/02/2054		26 600 000	26 388 469	0,78
UMBS, TBA, 6,5 %, 13/02/2054		3 350 000	3 429 278	0,10
			135 783 580	4,04
Métaux et minéraux précieux				
IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15/10/2028		15 828 000	13 928 640	0,41
Produits chimiques spéciaux				
CTEC II GmbH, 5,25 %, 15/02/2030	EUR	10 035 000	9 712 106	0,29
Télécommunications mobiles				
SBA Communications Corp., 3,875 %, 15/02/2027	USD	14 034 000	13 392 941	0,40
SBA Communications Corp., 3,125 %, 1/02/2029		19 299 000	17 199 904	0,51
			30 592 845	0,91
Transports - Services				
Q-Park Holding I B.V., 2 %, 1/03/2027	EUR	22 435 000	22 696 367	0,67
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, TIPS, 2,375 %, 15/01/2025	USD	67 523 235	67 263 429	2,00
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 31/03/2024 (g)		102 308 000	101 784 470	3,03
Bons du Trésor américain, 3 %, 30/06/2024		126 580 000	125 462 537	3,73
Bons du Trésor américain, 4,25 %, 30/09/2024		126 652 000	126 028 634	3,75
Bons du Trésor américain, 4,25 %, 31/12/2024		83 866 000	83 453 222	2,48
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 31/03/2025		85 219 000	84 509 951	2,51
Bons du Trésor américain, 1,625 %, 15/10/2027		51 412 095	51 288 921	1,52
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,5 %, 15/04/2024		33 947 376	33 767 030	1,00
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,125 %, 15/04/2027		102 135 064	96 578 810	2,87
			770 137 004	22,89
Services publics - Énergie électrique				
Clearway Energy Operating LLC, 4,75 %, 15/03/2028		14 216 000	13 535 092	0,40
Clearway Energy Operating LLC, 3,75 %, 15/02/2031		11 577 000	10 035 312	0,30
MidAmerican Energy Co., 3,5 %, 15/10/2024		8 452 000	8 345 497	0,25
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 4,255 %, 1/09/2024		9 935 000	9 857 101	0,29
Southern Co., 4,475 %, 1/08/2024		9 934 000	9 869 748	0,29
			51 642 750	1,53
Total des obligations (coût identifié, 1 339 237 691 \$)			1 319 181 564	39,21
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
ETF or				
iShares Physical Gold ETC		2 332 892	92 861 405	2,76
VanEck Junior Gold Miners UCITS ETF		663 950	19 773 980	0,59
Total des Fonds négociés en bourse (coût identifié, 113 492 546 \$)			112 635 385	3,35
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 21 093 000 \$)	USD	21 093 000	21 089 954	0,63
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 966 095 501 \$)			3 122 567 150	92,82

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Prudent Capital Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
Apple, Inc. – Mars 2024 @ 145 \$	59 764 040	3 241	55 097	0,00
Capital One Financial Corp. – Juin 2024 @ 95 \$	41 475 580	3 065	186 965	0,01
Digital Realty Trust, Inc. – Juin 2024 @ 90 \$	57 785 244	4 114	329 120	0,01
Euro Stoxx 50 Index – Septembre 2025 @ 3 500 EUR	125 588 147	2 500	2 380 242	0,07
Russell 2000 Index – Juin 2024 @ 1 400 \$	97 367 085	500	278 500	0,01
Russell 2000 Index – Juin 2024 @ 1 500 \$	77 893 668	400	320 000	0,01
Russell 2000 Index – Décembre 2025 @ 1 400 \$	97 367 085	500	2 150 000	0,06
S&P 500 Index – Juin 2024 @ 3 250 \$	116 295 360	240	168 000	0,00
S&P 500 Index – Juin 2024 @ 3 350 \$	116 295 360	240	192 000	0,01
S&P 500 Index – Juin 2024 @ 3 150 \$	121 141 000	250	152 500	0,00
S&P 500 Index – Août 2024 @ 4 200 \$	203 516 880	420	1 715 700	0,05
S&P 500 Index – Décembre 2024 @ 3 250 \$	145 369 200	300	732 000	0,02
S&P 500 Index – Juin 2025 @ 3 700 \$	152 637 660	315	2 296 350	0,07
S&P 500 Index – Décembre 2025 @ 3 300 \$	145 369 200	300	1 989 000	0,06
Total des options de vente achetées (primes versées, 52 491 773 \$)			12 945 474	0,38
Total des investissements (coût identifié, 3 018 587 274 \$) (k)			3 135 512 624	93,20
OPTIONS DE VENTE VENDUES				
Apple, Inc. – Mars 2024 @ 110 \$	(59 764 040)	(3 241)	(6 482)	(0,00)
Capital One Financial Corp. – Juin 2024 @ 65 \$	(41 475 580)	(3 065)	(444 425)	(0,01)
S&P 500 Index – Août 2024 @ 3 700 \$	(203 516 880)	(420)	(843 360)	(0,03)
Total des options de vente vendue (primes reçues, 4 675 962 \$)			(1 294 267)	(0,04)
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			229 940 546	6,84
ACTIF NET			3 364 158 903	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Safran S.A.	185 803	34 793 442	1,20
Thales S.A.	191 590	28 024 401	0,96
		62 817 843	2,16
Compagnies aériennes			
Enav S.p.A.	4 479 467	16 604 496	0,57
Boissons alcoolisées			
Beck's S.A.B. de C.V.	9 232 600	17 197 639	0,59
Heineken Holding N.V.	704 904	59 034 496	2,03
		76 232 135	2,62
Industrie automobile			
Knorr-Bremse AG	590 057	36 505 372	1,26
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
B3 S.A. - Brasil Bolsa Balcao	7 274 800	19 220 719	0,66
Euronext N.V.	266 893	23 499 572	0,81
IG Group Holdings PLC	2 526 162	22 625 740	0,78
		65 346 031	2,25
Services aux entreprises			
Serco Group PLC	23 149 807	50 465 693	1,73

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Logiciels			
Microsoft Corp.	39 531	15 716 735	0,54
Oracle Corp.	272 435	30 430 990	1,05
Oracle Corp. Japan	374 100	29 480 390	1,01
Sage Group PLC	3 181 039	47 399 807	1,63
		123 027 922	4,23
Logiciels - Systèmes			
Amadeus IT Group S.A.	748 143	52 297 581	1,80
Samsung Electronics Co. Ltd.	1 041 751	56 488 664	1,94
		108 786 245	3,74
Services de consommation			
Booking Holdings, Inc.	13 691	48 020 772	1,65
Conteneurs			
Mayr-Melnhof Karton AG	240 478	31 809 878	1,09
Équipements électriques			
Legrand S.A.	461 041	44 831 429	1,54
Électronique			
Kyocera Corp.	3 230 800	47 344 125	1,63
Alimentation et boissons			
Emmi AG	15 988	16 775 940	0,58
Assurances			
Beazley PLC	2 652 838	18 305 775	0,63
Hiscox Ltd.	1 581 552	20 824 690	0,72
		39 130 465	1,35
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	443 505	62 135 050	2,13
Scout24 AG	533 039	39 488 082	1,36
		101 623 132	3,49
Loisirs et jouets			
Games Workshop Group PLC	156 733	19 588 656	0,67
Nintendo Co. Ltd.	1 020 200	57 065 953	1,96
		76 654 609	2,63
Machines et outils			
Azbil Corp.	663 900	21 470 800	0,74
Équipements médicaux			
Agilent Technologies, Inc.	184 506	24 004 231	0,83
Bio-Rad Laboratories, Inc., "A"	134 587	43 187 622	1,48
Nakanishi, Inc.	1 391 600	22 858 017	0,79
Sonova Holding AG	131 738	42 039 796	1,44
		132 089 666	4,54
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Allfunds Group PLC	2 498 123	17 861 882	0,61
Edenred	231 630	13 872 878	0,48
S&P Global, Inc.	61 104	27 395 978	0,94
		59 130 738	2,03
Lutte contre la pollution			
Daiseki Co. Ltd.	936 560	26 755 323	0,92
Imprimerie et édition			
Wolters Kluwer N.V.	195 227	28 799 024	0,99
Immobilier			
CTP N.V.	1 586 379	27 156 098	0,93
Deutsche Konsum AG, REIT	1 900 168	6 714 984	0,23
Empire State Realty Trust, REIT, "A"	2 154 953	20 515 153	0,71
LEG Immobilien SE	840 001	70 147 117	2,41
Midland Holdings Ltd.	47 893 100	3 032 391	0,10
TAG Immobilien AG	2 079 606	29 348 417	1,01

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024
MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Immobilier, suite			
Triple Point Social Housing REIT PLC	18 620 647	13 635 580	0,47
		170 549 740	5,86
Restaurants			
Wetherspoons (J.D.) PLC	4 946 998	52 662 386	1,81
Produits chimiques spéciaux			
Nihon Parkerizing Co. Ltd.	1 952 800	15 542 044	0,54
Nitto Denko Corp.	524 600	43 441 012	1,49
		58 983 056	2,03
Magasins spécialisés			
Esprit Holdings Ltd.	25 457 300	928 035	0,03
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios S.A.	2 775 351	15 606 588	0,54
Zalando SE	1 361 416	27 483 558	0,94
		44 018 181	1,51
Télécommunications mobiles			
KDDI Corp.	1 615 000	53 439 466	1,84
Wireless Infrastructure Italian S.p.A.	3 024 124	36 750 588	1,26
		90 190 054	3,10
Services téléphoniques			
Altice USA, Inc., "A"	1 552 057	3 787 019	0,13
Hellenic Telecommunications Organization S.A.	1 470 818	20 425 246	0,70
		24 212 265	0,83
Transport par camion			
Yamato Holdings Co. Ltd.	1 901 400	32 922 110	1,13
Services publics - Énergie électrique			
Iberdrola S.A.	3 850 984	46 397 714	1,59
Total des actions ordinaires (coût identifié, 1 551 802 726 \$)		1 734 157 144	59,60
OBLIGATIONS			
Créances adossées à des actifs et titrisées			
LAD Auto Receivables Trust, 2023-2A, "A2", 5,93 %, 15/06/2027	USD 3 987 383	3 994 618	0,14
Toyota Lease Owner Trust, 2023-A, "A2", 5,3 %, 20/08/2025	1 934 754	1 932 811	0,06
		5 927 429	0,20
Biens de consommation			
Coty, Inc., 6,5 %, 15/04/2026	2 088 000	2 085 133	0,07
Assurances IARD			
Hiscox Ltd., 6,125 % jusqu'au 24/11/2025, FLR jusqu'au 24/11/2045	GBP 11 000 000	13 800 900	0,48
Titres adossés à des hypothèques			
Fannie Mae, UMBS, 6,5 %, 1/04/2043–1/09/2053	USD 2 961 218	3 034 736	0,09
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/01/2053–1/11/2053	8 237 042	8 273 784	0,29
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/11/2053	446 104	452 227	0,02
Freddie Mac, UMBS, 4,5 %, 1/06/2038–1/06/2053	24 190 700	23 582 967	0,82
Freddie Mac, UMBS, 6,5 %, 1/05/2043–1/11/2053	2 995 834	3 069 730	0,09
Freddie Mac, UMBS, 5,5 %, 1/09/2053	7 922 096	7 944 004	0,27
Freddie Mac, UMBS, 6 %, 1/11/2053	1 737 316	1 762 977	0,07
Ginnie Mae, 5,5 %, 20/02/2053	8 958 221	9 021 115	0,31
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/07/2053	8 467 704	8 241 399	0,28
Ginnie Mae, TBA, 5 %, 20/02/2054–20/03/2054	15 875 000	15 770 719	0,55
Ginnie Mae, TBA, 6 %, 20/02/2054	4 225 000	4 289 441	0,15
Ginnie Mae, TBA, 6,5 %, 20/02/2054–20/03/2054	5 875 000	6 001 912	0,20
UMBS, TBA, 5 %, 18/03/2039–13/02/2054	24 450 000	24 256 566	0,83
UMBS, TBA, 6,5 %, 13/02/2054	3 025 000	3 096 587	0,11
		118 798 164	4,08
Obligations du Trésor américain			
Obligations du Trésor américain, TIPS, 2,375 %, 15/01/2025	58 805 095	58 578 833	2,01
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 31/03/2024	89 300 000	88 843 035	3,05
Bons du Trésor américain, 3 %, 30/06/2024	110 431 000	109 456 102	3,76

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations du Trésor américain, suite				
Bons du Trésor américain, 4,25 %, 30/09/2024 (g)	USD	109 500 000	108 961 054	3,75
Bons du Trésor américain, 4,25 %, 31/12/2024		74 200 000	73 834 797	2,54
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 31/03/2025		74 600 000	73 979 305	2,54
Bons du Trésor américain, 1,625 %, 15/10/2027		44 778 096	44 670 815	1,54
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,5 %, 15/04/2024		29 705 780	29 547 968	1,02
Bons du Trésor américain, TIPS, 0,125 %, 15/04/2027		88 413 750	83 603 950	2,87
			671 475 859	23,08
Services publics - Énergie électrique				
MidAmerican Energy Co., 3,5 %, 15/10/2024		7 615 000	7 519 044	0,26
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 4,255 %, 1/09/2024		9 000 000	8 929 432	0,30
Southern Co., 4,475 %, 1/08/2024		9 000 000	8 941 789	0,31
			25 390 265	0,87
Total des obligations (coût identifié, 841 414 292 \$)			837 477 750	28,78
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
ETF or				
iShares Physical Gold ETC		2 257 769	89 871 114	3,09
VanEck Junior Gold Miners UCITS ETF		509 084	15 161 709	0,52
Total des Fonds négociés en bourse (coût identifié, 103 341 383 \$)			105 032 823	3,61
ACTIONS PRIVILÉGIÉES				
Alimentation et boissons				
ITO EN Ltd. (coût identifié, 19 388 565 \$)		1 094 800	14 148 047	0,48
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 17 392 000 \$)	USD	17 392 000	17 389 488	0,60
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 2 533 338 966 \$)			2 708 205 252	93,07

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal (\$)	Montant nominal/ Nombre de contrats		
OPTIONS DE VENTE ACHETÉES				
Apple, Inc. – Mars 2024 @ 145 \$	55 320 000	3 000	51 000	0,00
Capital One Financial Corp. – Juin 2024 @ 95 \$	38 024 920	2 810	171 410	0,01
Digital Realty Trust, Inc. – Juin 2024 @ 90 \$	52 672 500	3 750	300 000	0,01
Euro Stoxx 50 Index – Juin 2025 @ 3 600 EUR	113 029 332	2 250	2 030 365	0,07
Euro Stoxx 50 Index – Septembre 2025 @ 3 500 EUR	113 029 332	2 250	2 142 218	0,07
Russell 2000 Index – Juin 2024 @ 1 400 \$	97 367 085	500	278 500	0,01
Russell 2000 Index – Juin 2024 @ 1 500 \$	97 367 085	500	400 000	0,01
Russell 2000 Index – Juin 2024 @ 1 300 \$	97 367 085	500	190 000	0,01
Russell 2000 Index – Décembre 2024 @ 1 350 \$	97 367 085	500	875 000	0,03
Russell 2000 Index – Décembre 2025 @ 1 400 \$	107 103 794	550	2 365 000	0,08
S&P 500 Index – Juin 2024 @ 3 250 \$	169 597 400	350	245 000	0,01
S&P 500 Index – Juin 2024 @ 3 350 \$	169 597 400	350	280 000	0,01
S&P 500 Index – Juin 2024 @ 3 150 \$	169 597 400	350	213 500	0,01
S&P 500 Index – Août 2024 @ 4 200 \$	259 726 304	536	2 189 560	0,08
S&P 500 Index – Décembre 2024 @ 3 250 \$	133 255 100	275	671 000	0,02
S&P 500 Index – Juin 2025 @ 3 700 \$	138 100 740	285	2 077 650	0,07
S&P 500 Index – Décembre 2025 @ 3 300 \$	133 255 100	275	1 823 250	0,06
S&P 500 Index – Décembre 2025 @ 3 700 \$	121 141 000	250	2 575 000	0,09
Total des options de vente achetées (primes versées, 71 184 421 \$)			18 878 453	0,65
Total des investissements (coût identifié, 2 604 523 387 \$) (k)			2 727 083 705	93,72
OPTIONS DE VENTE VENDUES				
Apple, Inc. – Mars 2024 @ 110 \$	(55 320 000)	(3 000)	(6 000)	(0,00)
Capital One Financial Corp. – Juin 2024 @ 65 \$	(38 024 920)	(2 810)	(407 450)	(0,01)
S&P 500 Index – Août 2024 @ 3 700 \$	(259 726 304)	(536)	(1 076 288)	(0,04)

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - Prudent Wealth Fund, suite

Émetteur / Mois d'expiration / Prix d'exercice	Montant nominal/ Nombre de contrats	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OPTIONS DE VENTE VENDUES, suite			
Total des options de vente vendue (primes reçues, 5 635 602 \$)		(1 489 738)	(0,05)
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		184 074 124	6,33
ACTIF NET		2 909 668 091	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - U.K. Equity Fund

(en livres sterling)

Nom du titre

Valeurs mobilières et instruments du marché
monétaire négociés sur un marché réglementé

	Actions/Pair	Valeur de marché (£)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Babcock International Group PLC	46 105	208 056	1,27
QinetiQ Group PLC	77 629	277 010	1,69
		485 066	2,96
Boissons alcoolisées			
Diageo PLC	26 554	753 620	4,60
Industrie de la confection			
Burberry Group PLC	13 099	171 335	1,05
Radio-télévision			
WPP Group PLC	16 060	122 886	0,75
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
IG Group Holdings PLC	48 154	340 326	2,08
London Stock Exchange Group PLC	6 009	536 656	3,28
TP ICAP PLC	162 913	305 253	1,86
		1 182 235	7,22
Services aux entreprises			
Compass Group PLC	18 059	393 325	2,40
Experian PLC	19 201	631 662	3,86
Intertek Group PLC	6 528	292 247	1,78
IP Group PLC	219 530	115 034	0,70
Rentokil Initial PLC	43 893	178 821	1,09
RS Group PLC	27 648	216 129	1,32
		1 827 218	11,15
Logiciels			
Sage Group PLC	21 771	255 980	1,56
Construction			
Bellway PLC	3 789	103 695	0,63
Forterra PLC	79 814	130 767	0,80
		234 462	1,43
Biens de consommation			
Haleon PLC	91 383	293 796	1,79
Reckitt Benckiser Group PLC	8 641	492 374	3,01
		786 170	4,80
Énergie - Sociétés intégrées			
BP PLC	33 150	153 302	0,94
Harbour Energy PLC	61 354	169 740	1,04
Shell PLC	48 576	1 190 040	7,26
		1 513 082	9,24
Magasins d'alimentation et pharmacies			
Tesco PLC	179 494	513 868	3,14

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS **au 31 janvier 2024**
MFS Meridian Funds - U.K. Equity Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (£)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Jeux et hôtellerie			
Flutter Entertainment PLC	2 344	380 303	2,32
Whitbread PLC	8 848	316 821	1,93
		697 124	4,25
Marchandises générales			
B&M European Value Retail S.A.	38 764	200 233	1,22
Assurances			
Beazley PLC	47 125	256 596	1,57
Hiscox Ltd.	20 522	213 223	1,30
St. James's Place PLC	6 922	44 742	0,27
		514 561	3,14
Internet			
Informa PLC	29 221	227 164	1,38
Moneysupermarket.com Group PLC	49 322	125 678	0,77
		352 842	2,15
Machines et outils			
Weir Group PLC	12 616	229 548	1,40
Grandes banques			
Lloyds TSB Group PLC	961 896	406 081	2,48
NatWest Group PLC	223 525	500 177	3,05
		906 258	5,53
Équipements médicaux			
ConvaTec Group PLC	110 901	265 459	1,62
Métaux et exploitation minière			
Glencore PLC	135 770	570 845	3,48
Rio Tinto PLC	9 781	538 248	3,29
		1 109 093	6,77
Produits pharmaceutiques			
AstraZeneca PLC	9 670	1 015 350	6,20
Imprimerie et édition			
RELX PLC	28 375	925 593	5,65
Immobilier			
Unite Group PLC, REIT	26 589	267 585	1,63
Produits chimiques spéciaux			
Croda International PLC	4 416	212 189	1,30
Essentra PLC	87 317	151 058	0,92
		363 247	2,22
Télécommunications mobiles			
Vodafone Group PLC	272 521	183 684	1,12
Tabac			
British American Tobacco PLC	18 867	439 619	2,68
Imperial Brands PLC	24 905	471 520	2,88
		911 139	5,56
Services publics - Énergie électrique			
National Grid PLC	57 825	607 366	3,71
Total des actions ordinaires (coût identifié, 16 306 094 £)		16 395 004	100,07
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 16 306 094 £) (k)		16 395 004	100,07
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		(10 728)	(0,07)
ACTIF NET		16 384 276	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Concentrated Growth Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Industrie de la confection			
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	11 283	9 384 079	2,04
NIKE, Inc., "B"	111 419	11 312 371	2,46
		20 696 450	4,50
Industrie automobile			
Aptiv PLC	103 253	8 397 567	1,83
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
Charles Schwab Corp.	118 145	7 433 683	1,62
Services aux entreprises			
Accenture PLC, "A"	77 534	28 213 072	6,14
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	13 975	8 633 476	1,88
Microsoft Corp.	111 361	44 274 906	9,63
		52 908 382	11,51
Biens de consommation			
Church & Dwight Co., Inc.	190 275	18 998 959	4,13
Estée Lauder Cos., Inc., "A"	77 540	10 234 504	2,23
		29 233 463	6,36
Équipements électriques			
Amphenol Corp., "A"	209 790	21 209 769	4,61
Hubbell, Inc.	28 964	9 719 449	2,12
		30 929 218	6,73
Électronique			
Analog Devices, Inc.	98 072	18 865 130	4,11
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	105 924	11 965 175	2,60
		30 830 305	6,71
Alimentation et boissons			
McCormick & Co., Inc.	160 277	10 924 480	2,38
Assurances			
Aon PLC	69 205	20 652 848	4,49
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	235 196	32 950 960	7,17
Gartner, Inc.	23 375	10 692 660	2,32
		43 643 620	9,49
Machines et outils			
Eaton Corp. PLC	77 588	19 092 855	4,15
Veralto Corp.	15 863	1 216 534	0,27
		20 309 389	4,42
Technologies et services médicaux et de santé			
ICON PLC	54 772	14 288 372	3,11
Équipements médicaux			
Agilent Technologies, Inc.	123 034	16 006 723	3,48
Boston Scientific Corp.	231 754	14 660 758	3,19
Danaher Corp.	47 594	11 418 277	2,48
STERIS PLC	66 909	14 649 726	3,19
		56 735 484	12,34
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Moody's Corp.	29 157	11 430 710	2,49
Visa, Inc., "A"	121 300	33 146 438	7,21
		44 577 148	9,70
Magasins spécialisés			
TJX Cos., Inc.	184 652	17 525 321	3,81
Télécommunications mobiles			
American Tower Corp., REIT	64 950	12 707 468	2,76

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Services publics - Énergie électrique			
Xcel Energy, Inc.	141 576	8 476 155	1,84
Total des actions ordinaires (coût identifié, 351 473 157 \$)		458 482 425	99,74
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)			
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 121 000 \$)	USD 121 000	120 982	0,03
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 351 594 157 \$) (k)		458 603 407	99,77
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		1 075 266	0,23
ACTIF NET		459 678 673	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS			
Aérospatiale et défense			
General Dynamics Corp., 3,625 %, 1/04/2030	USD 1 687 000	1 605 823	0,27
L3 Harris Technologies, Inc., 5,4 %, 15/01/2027	2 740 000	2 794 385	0,48
L3 Harris Technologies, Inc., 5,4 %, 31/07/2033	2 803 000	2 887 188	0,49
TransDigm, Inc., 6,875 %, 15/12/2030	2 556 000	2 615 836	0,45
		9 903 232	1,69
Industrie de la confection			
Tapestry, Inc., 7 %, 27/11/2026	460 000	474 469	0,08
Tapestry, Inc., 3,05 %, 15/03/2032	906 000	724 611	0,12
		1 199 080	0,20
Créances adossées à des actifs et titrisées			
KREF 2018-FT1 Ltd., "A", FLR, 6,516 %, 15/02/2039	776 500	766 060	0,13
KREF 2018-FT1 Ltd., "AS", FLR, 6,746 %, 15/02/2039	853 500	820 908	0,14
LAD Auto Receivables Trust, 2023-2A, "A2", 5,93 %, 15/06/2027	1 326 718	1 329 125	0,23
OBX Trust, 2024-NQM1, "A1", 5,928 %, 25/11/2063	603 240	606 463	0,11
PFP III 2021-8 Ltd., "A", FLR, 6,452 %, 9/08/2037	424 382	420 720	0,07
PFP III 2021-8 Ltd., "AS", FLR, 6,702 %, 9/08/2037	1 587 000	1 539 752	0,26
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL5, "A", FLR, 6,45 %, 25/04/2038	295 514	294 298	0,05
Toyota Lease Owner Trust, 2023-A, "A2", 5,3 %, 20/08/2025	304 538	304 232	0,05
		6 081 558	1,04
Industrie automobile			
Ford Motor Credit Co. LLC, 5,8 %, 5/03/2027	1 097 000	1 104 007	0,19
Ford Motor Credit Co. LLC, 4,95 %, 28/05/2027	1 500 000	1 467 960	0,25
Hyundai Capital America, 5,3 %, 8/01/2029	1 126 000	1 142 064	0,19
Volkswagen Group of America Finance LLC, 6,2 %, 16/11/2028	2 089 000	2 197 214	0,38
		5 911 245	1,01
Radio-télévision			
Discovery Communications LLC, 4,125 %, 15/05/2029	1 500 000	1 423 564	0,24
Discovery Communications LLC, 5,3 %, 15/05/2049	984 000	852 513	0,14
Discovery Communications LLC, 4 %, 15/09/2055	2 262 000	1 592 582	0,27
Prosus N.V., 4,193 %, 19/01/2032	800 000	689 962	0,12
Prosus N.V., 3,832 %, 8/02/2051	1 541 000	952 754	0,16
Walt Disney Co., 3,5 %, 13/05/2040	3 038 000	2 521 375	0,43
Walt Disney Co., 4,75 %, 15/09/2044	281 000	267 216	0,05
Walt Disney Co., 3,6 %, 13/01/2051	1 912 000	1 498 503	0,26
WarnerMedia Holdings, Inc., 4,279 %, 15/03/2032	1 550 000	1 419 196	0,24

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Radio-télévision, suite				
WarnerMedia Holdings, Inc., 5,391 %, 15/03/2062	USD	1 672 000	1 438 736	0,25
			12 656 401	2,16
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Brookfield Finance, Inc., 2,34 %, 30/01/2032		3 043 000	2 461 586	0,42
Charles Schwab Corp., 5,643 % jusqu'au 19/05/2028, FLR jusqu'au 19/05/2029		863 000	882 981	0,15
Charles Schwab Corp., 1,95 %, 1/12/2031		968 000	777 680	0,13
Charles Schwab Corp., 6,136 % jusqu'au 24/08/2033, FLR jusqu'au 24/08/2034		1 605 000	1 696 260	0,29
LPL Holdings, Inc., 4,625 %, 15/11/2027		1 995 000	1 921 016	0,33
LPL Holdings, Inc., 6,75 %, 17/11/2028		544 000	571 918	0,10
LPL Holdings, Inc., 4,375 %, 15/05/2031		2 742 000	2 492 450	0,42
			10 803 891	1,84
Construction				
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp., 7,25 %, 15/01/2031		754 000	783 351	0,14
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030		2 327 000	2 159 705	0,37
Vulcan Materials Co., 4,5 %, 15/06/2047		673 000	601 088	0,10
			3 544 144	0,61
Services aux entreprises				
Fiserv, Inc., 2,25 %, 1/06/2027		1 850 000	1 715 662	0,29
Fiserv, Inc., 4,4 %, 1/07/2049		1 917 000	1 669 454	0,29
			3 385 116	0,58
Télévision par câble				
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 5,375 %, 1/05/2047		2 182 000	1 826 601	0,31
Comcast Corp., 2,887 %, 1/11/2051		2 943 000	1 948 362	0,34
Cox Communications, Inc., 5,7 %, 15/06/2033		2 584 000	2 643 408	0,45
Cox Communications, Inc., 4,5 %, 30/06/2043		420 000	352 747	0,06
Sirius XM Radio, Inc., 4,125 %, 1/07/2030		1 754 000	1 534 750	0,26
			8 305 868	1,42
Produits chimiques				
Sasol Financing (USA) LLC, 8,75 %, 3/05/2029		708 000	719 853	0,12
SCIH Salt Holdings, Inc., 4,875 %, 1/05/2028		2 264 000	2 102 305	0,36
			2 822 158	0,48
Logiciels				
Cisco Systems, Inc., 5,5 %, 15/01/2040		1 777 000	1 896 081	0,32
Microsoft Corp., 2,525 %, 1/06/2050		1 185 000	790 804	0,14
Microsoft Corp., 2,5 %, 15/09/2050		1 327 000	876 116	0,15
Oracle Corp., 5,55 %, 6/02/2053		4 357 000	4 329 800	0,74
VeriSign, Inc., 4,75 %, 15/07/2027		281 000	278 809	0,05
			8 171 610	1,40
Logiciels - Systèmes				
Apple, Inc., 2,05 %, 11/09/2026		1 673 000	1 576 806	0,27
Apple, Inc., 1,7 %, 5/08/2031		832 000	690 839	0,12
Apple, Inc., 2,65 %, 11/05/2050		1 428 000	964 695	0,16
Apple, Inc., 2,7 %, 5/08/2051		715 000	483 804	0,08
			3 716 144	0,63
Conglomérats				
nVent Finance S.à r.l., 5,65 %, 15/05/2033		1 808 000	1 855 698	0,31
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		1 584 000	1 607 202	0,27
Regal Rexnord Corp., 6,3 %, 15/02/2030		2 846 000	2 925 374	0,50
Regal Rexnord Corp., 6,4 %, 15/04/2033		1 168 000	1 213 818	0,21
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 3,2 %, 15/06/2025		1 435 000	1 394 581	0,24
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,7 %, 15/09/2028		1 349 000	1 336 123	0,23
			10 332 796	1,76
Biens de consommation				
Kenvue, Inc., 5 %, 22/03/2030		1 495 000	1 531 707	0,26

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Biens de consommation, suite				
Kenvue, Inc., 5,1 %, 22/03/2043	USD	1 268 000	1 299 626	0,22
Kenvue, Inc., 5,05 %, 22/03/2053		1 405 000	1 416 808	0,24
Mattel, Inc., 3,75 %, 1/04/2029		3 029 000	2 768 259	0,48
			7 016 400	1,20
Services de consommation				
Booking Holdings, Inc., 3,6 %, 1/06/2026		971 000	948 810	0,16
Booking Holdings, Inc., 4,625 %, 13/04/2030		1 134 000	1 137 105	0,19
CBRE Group, Inc., 5,95 %, 15/08/2034		3 374 000	3 490 747	0,60
			5 576 662	0,95
Électronique				
Intel Corp., 5,7 %, 10/02/2053		4 494 000	4 727 485	0,81
Lam Research Corp., 1,9 %, 15/06/2030		349 000	298 837	0,05
Lam Research Corp., 4,875 %, 15/03/2049		1 059 000	1 030 921	0,18
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 2,5 %, 11/05/2031		1 484 000	1 248 414	0,21
NXP B.V./NXP Funding LLC/NXP USA, Inc., 5 %, 15/01/2033		422 000	416 018	0,07
Sensata Technologies, Inc., 4,375 %, 15/02/2030		1 859 000	1 712 965	0,29
SK hynix, Inc., 6,25 %, 17/01/2026		1 261 000	1 275 964	0,22
SK hynix, Inc., 5,5 %, 16/01/2027		981 000	985 238	0,17
			11 695 842	2,00
Obligations quasi souveraines des marchés émergents				
Qatar Petroleum, 3,125 %, 12/07/2041		2 004 000	1 482 800	0,25
Obligations souveraines des marchés émergents				
États-Unis du Mexique, 6,338 %, 4/05/2053		2 101 000	2 094 286	0,36
Énergie - Sociétés indépendantes				
EQT Corp., 5,7 %, 1/04/2028		439 000	446 613	0,08
EQT Corp., 3,625 %, 15/05/2031		1 582 000	1 409 528	0,24
Occidental Petroleum Corp., 6,125 %, 1/01/2031		1 083 000	1 124 208	0,19
Occidental Petroleum Corp., 4,4 %, 15/04/2046		1 574 000	1 290 655	0,22
Permian Resources Operating LLC, 7 %, 15/01/2032		1 646 000	1 699 335	0,29
Pioneer Natural Resources Co., 5,1 %, 29/03/2026		1 294 100	1 303 042	0,22
Pioneer Natural Resources Co., 1,9 %, 15/08/2030		568 000	483 939	0,08
Pioneer Natural Resources Co., 2,15 %, 15/01/2031		2 704 000	2 303 408	0,40
Santos Finance Ltd., 6,875 %, 19/09/2033		2 517 000	2 679 713	0,46
			12 740 441	2,18
Énergie - Sociétés intégrées				
BP Capital Markets America, Inc., 1,749 %, 10/08/2030		1 355 000	1 138 879	0,19
BP Capital Markets America, Inc., 3,001 %, 17/03/2052		1 949 000	1 346 510	0,23
Eni S.p.A., 4,75 %, 12/09/2028		1 498 000	1 500 319	0,26
			3 985 708	0,68
Divertissement				
Royal Caribbean Cruises Ltd., 4,25 %, 1/07/2026		2 453 000	2 360 350	0,40
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,65 %, 21/07/2027		2 001 000	1 904 046	0,33
Avolon Holdings Funding Ltd., 3,25 %, 15/02/2027		1 209 000	1 122 793	0,19
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21/02/2028		923 000	826 121	0,14
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		1 911 000	1 841 726	0,31
Macquarie AirFinance Holdings Ltd., 8,125 %, 30/03/2029		1 645 000	1 706 802	0,29
			7 401 488	1,26
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4,375 %, 15/04/2038		583 000	554 473	0,10
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4,75 %, 15/04/2058		2 100 000	1 978 640	0,34
Bacardi-Martini B.V., 5,4 %, 15/06/2033		3 104 000	3 119 639	0,53
Constellation Brands, Inc., 2,25 %, 1/08/2031		1 376 000	1 148 063	0,20
Constellation Brands, Inc., 4,75 %, 9/05/2032		1 688 000	1 666 885	0,29
Constellation Brands, Inc., 3,75 %, 1/05/2050		1 050 000	819 008	0,14

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Alimentation et boissons, suite				
Diageo Capital PLC, 2 %, 29/04/2030	USD	1 769 000	1 528 760	0,26
Diageo Capital PLC, 5,625 %, 5/10/2033		1 862 000	1 988 395	0,34
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 5,5 %, 15/01/2030		378 000	369 295	0,06
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 3,75 %, 1/12/2031		2 018 000	1 729 823	0,30
JDE Peet's N.V., 0,8 %, 24/09/2024		1 145 000	1 107 534	0,19
JM Smucker Co., 6,5 %, 15/11/2053		1 256 000	1 419 122	0,24
Kraft Heinz Foods Co., 4,875 %, 1/10/2049		1 663 000	1 545 120	0,26
Kraft Heinz Foods Co., 5,5 %, 1/06/2050		1 990 000	2 016 250	0,34
Mars, Inc., 4,55 %, 20/04/2028		2 800 000	2 803 830	0,48
SYSCO Corp., 2,4 %, 15/02/2030		522 000	458 939	0,08
SYSCO Corp., 2,45 %, 14/12/2031		1 666 000	1 414 067	0,24
SYSCO Corp., 4,45 %, 15/03/2048		1 066 000	926 164	0,16
Viterra Finance B.V., 3,2 %, 21/04/2031		701 000	612 738	0,10
Viterra Finance B.V., 5,25 %, 21/04/2032		416 000	414 643	0,07
			27 621 388	4,72
Jeux et hôtellerie				
Marriott International, Inc., 4 %, 15/04/2028		322 000	312 749	0,05
Marriott International, Inc., 2,85 %, 15/04/2031		2 078 000	1 804 316	0,31
Marriott International, Inc., 3,5 %, 15/10/2032		1 323 000	1 179 805	0,20
VICI Properties LP, REIT, 4,75 %, 15/02/2028		1 120 000	1 096 658	0,19
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc., 4,25 %, 1/12/2026		1 676 000	1 613 572	0,28
Wynn Macau Ltd., 5,5 %, 1/10/2027		1 071 000	1 006 956	0,17
			7 014 056	1,20
Assurances				
Corebridge Financial, Inc., 3,9 %, 5/04/2032		2 309 000	2 079 967	0,36
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042		1 469 000	1 257 338	0,21
Equitable Holdings, Inc., 5,594 %, 11/01/2033		1 749 000	1 795 618	0,31
			5 132 923	0,88
Assurances - Santé				
Humana, Inc., 4,95 %, 1/10/2044		1 175 000	1 093 878	0,19
Humana, Inc., 5,5 %, 15/03/2053		467 000	467 732	0,08
UnitedHealth Group, Inc., 5,3 %, 15/02/2030		993 000	1 029 994	0,18
UnitedHealth Group, Inc., 4,625 %, 15/07/2035		1 659 000	1 659 177	0,28
UnitedHealth Group, Inc., 5,875 %, 15/02/2053		1 645 000	1 825 703	0,31
			6 076 484	1,04
Assurances IARD				
American International Group, Inc., 5,125 %, 27/03/2033		1 700 000	1 720 526	0,30
Arthur J. Gallagher & Co., 6,5 %, 15/02/2034		1 619 000	1 776 011	0,30
Arthur J. Gallagher & Co., 6,75 %, 15/02/2054		1 565 000	1 809 005	0,31
Fairfax Financial Holdings Ltd., 3,375 %, 3/03/2031		1 190 000	1 045 177	0,18
Fairfax Financial Holdings Ltd., 5,625 %, 16/08/2032		958 000	959 199	0,16
RenaissanceRe Holdings Ltd., 5,75 %, 5/06/2033		2 118 000	2 148 528	0,37
			9 458 446	1,62
Obligations quasi souveraines du marché international				
NBN Co. Ltd. (Commonwealth d'Australie), 5,75 %, 6/10/2028		2 101 000	2 185 738	0,37
Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties, 2,5 %, 15/10/2031		2 770 000	2 230 086	0,38
			4 415 824	0,75
Obligations souveraines du marché international				
Gouvernement des Bermudes, 5 %, 15/07/2032		3 473 000	3 368 810	0,58
Machines et outils				
Ashtead Capital, Inc., 4,375 %, 15/08/2027		458 000	442 295	0,07
Ashtead Capital, Inc., 5,55 %, 30/05/2033		1 746 000	1 731 543	0,30
Ashtead Capital, Inc., 5,95 %, 15/10/2033		1 156 000	1 177 358	0,20
CNH Industrial Capital LLC, 5,45 %, 14/10/2025		1 521 000	1 531 483	0,26
CNH Industrial Capital LLC, 5,5 %, 12/01/2029		1 980 000	2 036 210	0,35

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Machines et outils, suite				
CNH Industrial N.V., 3,85 %, 15/11/2027	USD	1 445 000	1 397 493	0,24
			8 316 382	1,42
Grandes banques				
Bank of America Corp., 4,376 % jusqu'au 27/04/2027, FLR jusqu'au 27/04/2028		3 850 000	3 774 689	0,65
Bank of America Corp., 5,819 % jusqu'au 15/09/2028, FLR jusqu'au 15/09/2029		3 062 000	3 165 840	0,54
Bank of America Corp., 5,872 % jusqu'au 15/09/2033, FLR jusqu'au 15/09/2034		2 627 000	2 750 856	0,47
Bank of New York Mellon Corp., 5,802 % jusqu'au 25/10/2027, FLR jusqu'au 25/10/2028		631 000	654 355	0,11
Barclays PLC, 2,894 % jusqu'au 24/11/2031, FLR jusqu'au 24/11/2032		2 833 000	2 338 925	0,40
Capital One Financial Corp., 6,312 % jusqu'au 8/06/2028, FLR jusqu'au 8/06/2029		1 080 000	1 113 376	0,19
Capital One Financial Corp., 6,377 % jusqu'au 8/06/2033, FLR jusqu'au 8/06/2034		680 000	706 541	0,12
Comerica, Inc., 5,982 % jusqu'au 30/01/2029, FLR jusqu'au 30/01/2030		1 668 000	1 662 998	0,28
Commonwealth Bank of Australia, 3,61 % jusqu'au 12/09/2029, FLR jusqu'au 12/09/2034		2 378 000	2 147 367	0,37
Commonwealth Bank of Australia, 3,305 %, 11/03/2041		1 883 000	1 368 775	0,23
Credit Agricole S.A., 1,247 % jusqu'au 26/01/2026, FLR jusqu'au 26/01/2027		4 029 000	3 729 175	0,64
Deutsche Bank AG, 7,079 % jusqu'au 10/02/2023, FLR jusqu'au 10/02/2034		2 308 000	2 355 260	0,40
HSBC Holdings PLC, 2,357 % jusqu'au 18/08/2030, FLR jusqu'au 18/08/2031		1 509 000	1 260 762	0,22
HSBC Holdings PLC, 2,871 % jusqu'au 22/11/2031, FLR jusqu'au 22/11/2032		1 976 000	1 650 349	0,28
Huntington Bancshares, Inc., 6,208 % jusqu'au 21/08/2028, FLR jusqu'au 21/08/2029		1 683 000	1 739 486	0,30
JPMorgan Chase & Co., 6,07 % jusqu'au 22/10/2026, FLR jusqu'au 22/10/2027		2 574 000	2 651 423	0,45
JPMorgan Chase & Co., 4,323 % jusqu'au 26/04/2027, FLR jusqu'au 26/04/2028		2 930 000	2 882 730	0,49
JPMorgan Chase & Co., 2,545 % jusqu'au 8/11/2031, FLR jusqu'au 8/11/2032		5 682 000	4 764 762	0,81
JPMorgan Chase & Co., 5,336 % jusqu'au 23/01/2034, FLR jusqu'au 23/01/2035		1 026 000	1 042 681	0,18
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 5,719 % jusqu'au 20/02/2025, FLR jusqu'au 20/02/2026		2 373 000	2 382 234	0,41
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 1,64 % jusqu'au 13/10/2026, FLR jusqu'au 13/10/2027		2 548 000	2 332 618	0,40
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,494 % jusqu'au 13/10/2031, FLR jusqu'au 13/10/2032		1 656 000	1 386 415	0,24
Mizuho Financial Group, 5,754 %, 27/05/2034		1 691 000	1 749 153	0,30
Morgan Stanley, 0,985 % jusqu'au 10/12/2025, FLR jusqu'au 10/12/2026		3 000 000	2 771 334	0,47
Morgan Stanley, 5,449 % jusqu'au 20/07/2028, FLR jusqu'au 20/07/2029		1 624 000	1 652 880	0,28
Morgan Stanley, 3,622 % jusqu'au 1/04/2030, FLR jusqu'au 1/04/2031		2 067 000	1 907 134	0,33
Morgan Stanley, 5,424 % jusqu'au 21/07/2033, FLR jusqu'au 21/07/2034		1 398 000	1 416 108	0,24
National Australia Bank Ltd., 3,347 % jusqu'au 12/01/2032, FLR jusqu'au 12/01/2037		2 801 000	2 359 909	0,40
Nationwide Construction Society, 6,557 % jusqu'au 18/10/2026, FLR jusqu'au 18/10/2027		1 707 000	1 762 337	0,30
NatWest Group PLC, 5,847 % jusqu'au 2/03/2026, FLR jusqu'au 2/03/2027		1 351 000	1 363 716	0,23
Nordea Bank Abp, 1,5 %, 30/09/2026		2 963 000	2 711 156	0,46
PNC Financial Services Group, Inc., 5,3 % jusqu'au 21/01/2027, FLR jusqu'au 21/01/2028		1 212 000	1 222 731	0,21
PNC Financial Services Group, Inc., 5,676 % jusqu'au 22/01/2034, FLR jusqu'au 22/01/2035		1 443 000	1 480 808	0,25
Royal Bank of Canada, 2,3 %, 3/11/2031		3 032 000	2 537 768	0,43
Royal Bank of Canada, 5 %, 1/02/2033		650 000	650 107	0,11
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 1,71 %, 12/01/2031		3 483 000	2 803 908	0,48
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 5,65 %, 9/03/2026		2 780 000	2 819 551	0,48
Toronto-Dominion Bank, 4,108 %, 8/06/2027		1 027 000	1 007 771	0,17
Toronto-Dominion Bank, 4,693 %, 15/09/2027		2 204 000	2 200 301	0,38
Toronto-Dominion Bank, 2 %, 10/09/2031		1 377 000	1 139 628	0,20
UBS Group AG, 3,126 % jusqu'au 13/08/2029, FLR jusqu'au 13/08/2030		4 522 000	4 048 379	0,69
UBS Group AG, 4,375 % jusqu'au 10/02/2031, FLR jusqu'au 10/08/2171		3 578 000	2 836 973	0,49
UBS Group AG, 9,25 % jusqu'au 13/11/2033, FLR jusqu'au 13/05/2172		722 000	786 555	0,13
UniCredit S.p.A., 2,569 % jusqu'au 22/09/2025, FLR jusqu'au 22/09/2026		2 553 000	2 418 558	0,41
UniCredit S.p.A., 1,982 % jusqu'au 3/06/2026, FLR jusqu'au 3/06/2027		2 202 000	2 028 762	0,35
Wells Fargo & Co., 3,908 % jusqu'au 25/04/2025, FLR jusqu'au 25/04/2026		1 911 000	1 878 626	0,32
Wells Fargo & Co., 5,574 % jusqu'au 25/07/2028, FLR jusqu'au 25/07/2029		1 549 000	1 583 104	0,27
Wells Fargo & Co., 3,35 % jusqu'au 2/03/2032, FLR jusqu'au 2/03/2033		992 000	870 719	0,15
			97 869 593	16,71
Technologies et services médicaux et de santé				
Alcon Finance Corp., 2,6 %, 27/05/2030		2 428 000	2 124 359	0,36

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Technologies et services médicaux et de santé, suite				
Alcon Finance Corp., 3,8 %, 23/09/2049	USD	781 000	620 798	0,11
Becton, Dickinson and Co., 2,823 %, 20/05/2030		1 984 000	1 772 903	0,30
Becton, Dickinson and Co., 4,298 %, 22/08/2032		941 000	906 504	0,15
Becton, Dickinson and Co., 4,685 %, 15/12/2044		142 000	132 743	0,02
CVS Health Corp., 5 %, 20/02/2026		1 082 000	1 085 567	0,19
CVS Health Corp., 5,625 %, 21/02/2053		1 386 000	1 380 049	0,24
HCA, Inc., 5,2 %, 1/06/2028		1 564 000	1 579 756	0,27
HCA, Inc., 5,875 %, 1/02/2029		1 447 000	1 492 412	0,26
IQVIA, Inc., 6,25 %, 1/02/2029		1 546 000	1 608 947	0,27
Marin General Hospital, 7,242 %, 1/08/2045		915 000	972 610	0,17
Thermo Fisher Scientific, Inc., 4,977 %, 10/08/2030		1 566 000	1 600 870	0,27
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2 %, 15/10/2031		1 388 000	1 160 294	0,20
Thermo Fisher Scientific, Inc., 2,8 %, 15/10/2041		425 000	318 379	0,05
			16 756 191	2,86
Équipements médicaux				
Danaher Corp., 2,6 %, 1/10/2050		1 667 000	1 091 186	0,19
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 4,5 %, 15/03/2028		407 000	396 194	0,07
Anglo American Capital PLC, 2,625 %, 10/09/2030		1 980 000	1 691 857	0,29
FMG Resources Ltd., 4,375 %, 1/04/2031		2 702 000	2 431 782	0,42
Glencore Funding LLC, 3,875 %, 27/10/2027		1 097 000	1 057 083	0,18
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031		2 336 000	2 019 078	0,34
Novelis Corp., 4,75 %, 30/01/2030		1 962 000	1 819 746	0,31
			9 415 740	1,61
Secteur intermédiaire				
Columbia Pipelines Holdings Co. LLC, 6,055 %, 15/08/2026		422 000	431 480	0,07
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 6,497 %, 15/08/2043		64 000	69 963	0,01
Columbia Pipelines Operating Co. LLC, 6,544 %, 15/11/2053		2 621 000	2 878 284	0,49
Enbridge, Inc., 5,969 %, 8/03/2026		815 000	814 964	0,14
Enbridge, Inc., 8,5 % jusqu'au 15/01/2034, FLR jusqu'au 15/01/2084		1 943 000	2 077 251	0,36
Energy Transfer LP, 4 %, 1/10/2027		1 174 000	1 133 895	0,19
Energy Transfer LP, 5,95 %, 15/05/2054		1 107 000	1 110 148	0,19
Energy Transfer LP, 7,125 % jusqu'au 15/05/2030, FLR jusqu'au 15/05/2171		1 892 000	1 828 903	0,31
EQM Midstream Partners LP, 4,5 %, 15/01/2029		965 000	907 861	0,16
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 1,75 %, 30/09/2027		3 008 630	2 818 793	0,48
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd., 2,16 %, 31/03/2034		806 118	691 862	0,12
Plains All American Pipeline LP, 4,65 %, 15/10/2025		1 635 000	1 622 731	0,28
Plains All American Pipeline LP, 3,55 %, 15/12/2029		2 373 000	2 183 762	0,37
Plains All American Pipeline LP, 4,9 %, 15/02/2045		1 318 000	1 152 869	0,20
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		1 629 000	1 491 208	0,25
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		2 344 000	2 044 212	0,35
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 6,25 %, 15/01/2030		578 000	578 459	0,10
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15/08/2031		676 000	597 801	0,10
Venture Global LNG, Inc., 9,5 %, 1/02/2029		908 000	964 331	0,17
			25 398 777	4,34
Obligations municipales				
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 2,746 %, 1/06/2034		885 000	738 970	0,13
Gaz naturel - Gazoducs				
APA Infrastructure Ltd., 5 %, 23/03/2035		691 000	653 608	0,11
Pétrole				
MC Brazil Downstream Trading S.à r.l., 7,25 %, 30/06/2031		2 403 500	1 847 863	0,31
Puma International Financing S.A., 5 %, 24/01/2026		1 215 000	1 150 799	0,20
			2 998 662	0,51

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
AIB Group PLC, 6,608 % jusqu'au 13/09/2028, FLR jusqu'au 13/09/2029	USD	3 250 000	3 414 303	0,58
BBVA Bancomer S.A. (Texas), 8,125 %, 8/01/2039		2 251 000	2 290 111	0,39
BPCE S.A., 5,716 % jusqu'au 18/01/2029, FLR jusqu'au 18/01/2030		2 188 000	2 202 582	0,38
CaixaBank S.A., 6,84 % jusqu'au 13/09/2033, FLR jusqu'au 13/09/2034		2 155 000	2 292 124	0,39
Intesa Sanpaolo S.p.A., 7,2 %, 28/11/2033		1 346 000	1 442 014	0,25
Intesa Sanpaolo S.p.A., 7,8 %, 28/11/2053		1 068 000	1 171 365	0,20
M&T Bank Corp., 7,413 % jusqu'au 30/10/2028, FLR jusqu'au 30/10/2029		143 000	154 065	0,03
M&T Bank Corp., 5,053 % jusqu'au 27/01/2033, FLR jusqu'au 27/01/2034		681 000	642 373	0,11
Macquarie Group Ltd., 5,887 %, 15/06/2034		1 976 000	2 024 486	0,34
Macquarie Group Ltd., 6,255 % jusqu'au 7/12/2033, FLR jusqu'au 7/12/2034		1 370 000	1 439 218	0,25
Manufacturers and Traders Trust Co., 4,7 %, 27/01/2028		1 393 000	1 365 333	0,23
Truist Financial Corp., 7,161 % jusqu'au 30/10/2028, FLR jusqu'au 30/10/2029		2 568 000	2 773 351	0,47
Truist Financial Corp., 5,711 % jusqu'au 24/01/2034, FLR jusqu'au 24/01/2035		1 050 000	1 067 701	0,18
			22 279 026	3,80
Produits pharmaceutiques				
Bayer US Finance LLC, 6,125 %, 21/11/2026		1 238 000	1 256 649	0,22
Bayer US Finance LLC, 6,25 %, 21/01/2029		1 554 000	1 589 294	0,27
Merck & Co., Inc., 2,75 %, 10/12/2051		1 070 000	718 223	0,12
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 4,75 %, 19/05/2033		2 899 000	2 895 406	0,50
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd., 5,3 %, 19/05/2053		1 170 000	1 189 605	0,20
Pfizer, Inc., 2,55 %, 28/05/2040		658 000	476 987	0,08
Roche Holdings, Inc., 5,338 %, 13/11/2028		2 730 000	2 829 224	0,48
Roche Holdings, Inc., 5,489 %, 13/11/2030		1 425 000	1 501 584	0,26
			12 456 972	2,13
Lutte contre la pollution				
GFL Environmental, Inc., 3,5 %, 1/09/2028		1 883 000	1 704 499	0,29
GFL Environmental, Inc., 6,75 %, 15/01/2031		1 126 000	1 151 648	0,20
Waste Management, Inc., 4,625 %, 15/02/2033		2 478 000	2 460 251	0,42
			5 316 398	0,91
Métaux et minéraux précieux				
IAMGOLD Corp., 5,75 %, 15/10/2028		1 802 000	1 585 760	0,27
Northern Star Resources Ltd. Co., 6,125 %, 11/04/2033		2 245 000	2 288 144	0,39
			3 873 904	0,66
Chemins de fer et transport maritime				
Burlington Northern Santa Fe, LLC, 5,2 %, 15/04/2054		1 893 000	1 929 363	0,33
Canadian Pacific Railway Co., 3,1 %, 2/12/2051		1 774 000	1 253 265	0,21
			3 182 628	0,54
Immobilier - Bureaux				
Boston Properties LP, REIT, 3,65 %, 1/02/2026		1 484 000	1 433 186	0,24
Boston Properties LP, REIT, 4,5 %, 1/12/2028		114 000	108 894	0,02
Boston Properties LP, REIT, 2,45 %, 1/10/2033		440 000	334 723	0,06
Corporate Office Property LP, REIT, 2 %, 15/01/2029		2 767 000	2 324 770	0,40
Corporate Office Property LP, REIT, 2,75 %, 15/04/2031		3 658 000	2 986 370	0,51
			7 187 943	1,23
Immobilier - Autres				
EPR Properties, REIT, 3,6 %, 15/11/2031		2 767 000	2 314 224	0,40
Extra Space Storage LP, 5,5 %, 1/07/2030		2 146 000	2 194 607	0,37
Lexington Realty Trust Co., REIT, 2,375 %, 1/10/2031		2 141 000	1 724 845	0,29
Prologis LP, REIT, 5,125 %, 15/01/2034		3 286 000	3 337 387	0,57
W.P. Carey, Inc., REIT, 2,45 %, 1/02/2032		2 068 000	1 689 539	0,29
			11 260 602	1,92
Immobilier - Distribution				
NNN REIT, Inc., 5,6 %, 15/10/2033		1 918 000	1 961 783	0,34
STORE Capital Corp., REIT, 2,7 %, 1/12/2031		3 462 000	2 712 972	0,46
			4 674 755	0,80

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Distribution				
Alimentation Couche-Tard, Inc., 3,439 %, 13/05/2041	USD	282 000	212 651	0,04
Alimentation Couche-Tard, Inc., 3,8 %, 25/01/2050		2 541 000	1 923 969	0,33
Amazon.com, Inc., 3,6 %, 13/04/2032		1 514 000	1 428 655	0,24
AutoZone, Inc., 4,75 %, 1/08/2032		1 936 000	1 902 504	0,32
Home Depot, Inc., 3,3 %, 15/04/2040		2 200 000	1 806 582	0,31
Home Depot, Inc., 3,9 %, 15/06/2047		276 000	233 786	0,04
			7 508 147	1,28
Produits chimiques spéciaux				
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,23 %, 1/10/2025		897 000	835 897	0,14
International Flavors & Fragrances, Inc., 1,832 %, 15/10/2027		619 000	548 470	0,09
International Flavors & Fragrances, Inc., 2,3 %, 1/11/2030		607 000	505 241	0,09
International Flavors & Fragrances, Inc., 5 %, 26/09/2048		512 000	437 486	0,08
International Flavors & Fragrances, Inc., 3,468 %, 1/12/2050		875 000	594 073	0,10
			2 921 167	0,50
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		955 000	812 000	0,14
DICK'S Sporting Goods, 4,1 %, 15/01/2052		1 464 000	1 060 167	0,18
			1 872 167	0,32
Télécommunications mobiles				
Cellnex Finance Co. S.A., 3,875 %, 7/07/2041		4 244 000	3 307 789	0,57
Crown Castle, Inc., REIT, 4,45 %, 15/02/2026		1 064 000	1 050 261	0,18
Crown Castle, Inc., REIT, 3,65 %, 1/09/2027		1 496 000	1 424 297	0,24
Millicom International Cellular S.A., 4,5 %, 27/04/2031		1 800 000	1 516 500	0,26
Rogers Communications, Inc., 3,8 %, 15/03/2032		1 408 000	1 280 701	0,22
Rogers Communications, Inc., 4,5 %, 15/03/2042		1 320 000	1 172 864	0,20
Rogers Communications, Inc., 4,55 %, 15/03/2052		1 043 000	896 324	0,15
T-Mobile USA, Inc., 2,05 %, 15/02/2028		2 391 000	2 157 309	0,37
T-Mobile USA, Inc., 5,05 %, 15/07/2033		2 298 000	2 300 647	0,39
T-Mobile USA, Inc., 3 %, 15/02/2041		3 397 000	2 538 477	0,43
Vodafone Group PLC, 5,625 %, 10/02/2053		3 424 000	3 449 369	0,59
			21 094 538	3,60
Tabac				
B.A.T. Capital Corp., 6,343 %, 2/08/2030		2 678 000	2 819 731	0,48
Philip Morris International, Inc., 5,625 %, 17/11/2029		490 000	511 387	0,09
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 15/02/2030		2 207 000	2 243 365	0,38
			5 574 483	0,95
Transports - Services				
Element Fleet Management Corp., 6,271 %, 26/06/2026		1 575 000	1 603 467	0,27
Element Fleet Management Corp., 6,319 %, 4/12/2028		2 783 000	2 892 050	0,50
			4 495 517	0,77
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 2,375 %, 15/02/2042		11 036 000	8 351 148	1,43
Obligations du Trésor américain, 3,875 %, 15/05/2043		13 767 000	12 953 886	2,21
Obligations du Trésor américain, 4,375 %, 15/08/2043		5 550 000	5 589 891	0,96
Obligations du Trésor américain, 2,875 %, 15/05/2052		2 100 000	1 622 332	0,28
Obligations du Trésor américain, 4,125 %, 15/08/2053		558 000	548 671	0,09
Bons du Trésor américain, 4,625 %, 30/06/2025		3 000 000	3 007 031	0,51
Bons du Trésor américain, 5 %, 31/10/2025		3 000 000	3 034 102	0,52
Bons du Trésor américain, 4,875 %, 30/11/2025		2 498 000	2 523 956	0,43
			37 631 017	6,43
Services publics - Énergie électrique				
Adani Transmission Ltd., 4 %, 3/08/2026		1 653 000	1 553 820	0,27
AEP Transmission Co. LLC, 5,4 %, 15/03/2053		1 107 000	1 127 746	0,19
American Electric Power Co., Inc., 5,699 %, 15/08/2025		598 000	602 599	0,10
American Transmission Systems, Inc., 2,65 %, 15/01/2032		432 000	363 163	0,06

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Corporate Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services publics - Énergie électrique, suite				
Berkshire Hathaway Energy Co., 5,15 %, 15/11/2043	USD	416 000	412 274	0,07
Berkshire Hathaway Energy Co., 4,6 %, 1/05/2053		346 000	305 638	0,05
CenterPoint Energy, Inc., 2,65 %, 1/06/2031		1 295 000	1 100 323	0,19
Duke Energy Carolinas LLC, 2,45 %, 1/02/2030		2 725 000	2 414 985	0,41
Duke Energy Florida LLC, 6,2 %, 15/11/2053		1 130 000	1 264 536	0,22
Enel Finance International N.V., 4,625 %, 15/06/2027		1 203 000	1 194 735	0,20
Enel Finance International N.V., 2,25 %, 12/07/2031		1 754 000	1 430 410	0,25
Enel Finance International N.V., 5,5 %, 15/06/2052		500 000	474 649	0,08
Enel Finance International N.V., 7,75 %, 14/10/2052		1 482 000	1 825 235	0,31
Eversource Energy, 5,5 %, 1/01/2034		1 558 000	1 575 855	0,27
FirstEnergy Corp., 4,15 %, 15/07/2027		2 463 000	2 365 134	0,40
FirstEnergy Corp., 2,65 %, 1/03/2030		1 694 000	1 471 883	0,25
FirstEnergy Corp., 3,4 %, 1/03/2050		2 226 000	1 541 455	0,26
Florida Power & Light Co., 2,45 %, 3/02/2032		982 000	837 311	0,14
Florida Power & Light Co., 3,95 %, 1/03/2048		729 000	609 772	0,11
Georgia Power Co., 4,7 %, 15/05/2032		1 837 000	1 813 994	0,31
Georgia Power Co., 4,95 %, 17/05/2033		1 656 000	1 656 540	0,28
Georgia Power Co., 5,125 %, 15/05/2052		1 839 000	1 813 375	0,31
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		3 117 000	2 627 145	0,45
MidAmerican Energy Co., 5,85 %, 15/09/2054		2 001 000	2 186 985	0,37
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 6,051 %, 1/03/2025		787 000	793 634	0,14
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 5,749 %, 1/09/2025		1 554 000	1 569 693	0,27
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 2,44 %, 15/01/2032		529 000	438 653	0,08
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 3,8 % jusqu'au 15/03/2027, FLR jusqu'au 15/03/2082		1 223 000	1 069 820	0,18
Pacific Gas & Electric Co., 5,45 %, 15/06/2027		1 298 000	1 305 696	0,22
Pacific Gas & Electric Co., 2,5 %, 1/02/2031		3 587 000	2 977 180	0,51
PPL Electric Utilities Corp., 4,85 %, 15/02/2034		1 548 000	1 552 705	0,27
Southern California Edison Co., 4,5 %, 1/09/2040		727 000	652 199	0,11
Southern California Edison Co., 3,65 %, 1/02/2050		890 000	676 775	0,12
Virginia Electric & Power Co., 2,875 %, 15/07/2029		1 374 000	1 268 811	0,22
WEC Energy Group, Inc., 4,75 %, 9/01/2026		3 355 000	3 347 166	0,57
			48 221 894	8,24
Total des obligations (coût identifié, 574 507 909 \$)			567 065 418	96,85
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 1 208 000 \$)	USD	1 208 000	1 207 825	0,20
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 575 715 909 \$)			568 273 243	97,05
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			17 257 249	2,95
ACTIF NET			585 530 492	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - U.S. Government Bond Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS				
Créances adossées à des actifs et titrisées				
ACREC 2021-FL1 Ltd., "AS", FLR, 6,949 %, 16/10/2036	USD	993 000	971 389	0,27
ACREC 2023-FL2 LLC, "A", FLR, 7,563 %, 19/02/2038		771 366	771 050	0,22
Arbor Multi-Family Mortgage Securities Trust, 2021-MF3, "XA", 0,739 %, 15/10/2054 (i)		8 497 697	311 830	0,09
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL3, "AS", FLR, 6,847 %, 15/08/2034		849 000	827 395	0,23

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Government Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
AREIT 2022-CRE6 Trust, "AS", FLR, 6,995 %, 20/01/2037	USD	1 068 500	1 048 688	0,30
AREIT 2023-CRE8 Trust LLC, "A", FLR, 7,432 %, 17/08/2041		634 468	632 492	0,18
BSPDF 2021-FL1 Issuer Ltd., "A", FLR, 6,647 %, 15/10/2036		464 887	456 267	0,13
BSPDF 2021-FL1 Issuer Ltd., "AS", FLR, 6,927 %, 15/10/2036		598 500	576 569	0,16
BXMT 2021-FL4 Ltd., "AS", FLR, 6,746 %, 15/05/2038		1 085 500	1 010 319	0,29
Consumers 2023 Securitization Funding LLC, 5,55 %, 1/03/2028		420 000	421 688	0,12
Dryden Senior Loan Fund, 2022-113A, "A1R", CLO, FLR, 7,045 %, 20/10/2035		2 600 000	2 606 191	0,74
Flagship Credit Auto Trust, 2019-3, "D", 2,86 %, 15/12/2025		270 741	268 013	0,08
GLGU 2023-1A Ltd., "A", FLR, 7,617 %, 20/07/2035		700 000	706 864	0,20
KREF 2018-FT1 Ltd., "AS", FLR, 6,746 %, 15/02/2039		270 500	260 171	0,07
LAD Auto Receivables Trust, 2023-1A, "A2", 5,68 %, 15/10/2026		204 938	204 678	0,06
LAD Auto Receivables Trust, 2023-2A, "A2", 5,93 %, 15/06/2027		640 584	641 746	0,18
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "AS", FLR, 7,198 %, 15/07/2036		921 500	908 106	0,26
LoanCore 2021-CRE6 Ltd., "AS", FLR, 7,097 %, 15/11/2038		1 008 500	983 189	0,28
MF1 2021-FL5 Ltd., "AS", FLR, 6,646 %, 15/07/2036		846 000	828 384	0,23
MF1 2021-FL5 Ltd., "B", FLR, 6,896 %, 15/07/2036		726 000	712 053	0,20
MF1 2023-FL12 LLC, FLR, "A", 7,401 %, 19/10/2038		1 594 000	1 596 712	0,45
Morgan Stanley Capital I Trust, 2018-H4, "XA", 0,806 %, 15/12/2051 (i)		3 338 053	107 768	0,03
Neuberger Berman CLO Ltd., 2023-53A, "B", FLR, 7,589 %, 24/10/2032		812 587	813 907	0,23
OBX Trust, 2024-NQM1, "A1", 5,928 %, 25/11/2063		822 977	827 374	0,23
OBX Trust, 2024-NQM2, "A1", 5,878 %, 25/12/2063		1 714 945	1 718 053	0,49
Onslow Bay Financial LLC OBX Trust, 2024-NQM1, "A2", 6,253 %, 25/11/2063		168 536	169 582	0,05
PPF III 2021-8 Ltd., "AS", FLR, 6,702 %, 9/08/2037		717 000	695 653	0,20
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "A", FLR, 6,65 %, 25/11/2036		356 206	353 912	0,10
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "AS", FLR, 6,95 %, 25/11/2036		158 500	154 478	0,04
Toyota Lease Owner Trust, 2023-A, "A2", 5,3 %, 20/08/2025		564 334	563 767	0,16
Verus Securitization Trust, 2014-1, "A1", 5,712 %, 25/01/2069		1 057 507	1 056 735	0,30
Verus Securitization Trust, 2024-1, "A2", 5,915 %, 25/01/2069		295 532	295 309	0,08
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, 2018-C48, "XA", 0,934 %, 15/01/2052 (i)		1 878 056	66 110	0,02
Westlake Automobile Receivables Trust, 2022-3A, "A2", 5,24 %, 15/07/2025		97 917	97 871	0,03
Westlake Automobile Receivables Trust, 2023-1A, "A2B", FLR, 6,196 %, 15/06/2026		92 618	92 689	0,03
World Omni Select Auto Trust 2023-A, "A2B", FLR, 6,196 %, 15/03/2027		882 233	883 184	0,25
			24 640 186	6,98
Services de consommation				
Conservation Fund, 3,474 %, 15/12/2029		382 000	347 957	0,10
Industrie				
Howard University, Washington D.C., AGM, 2,516 %, 1/10/2025		110 000	106 080	0,03
Technologies et services médicaux et de santé				
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,325 %, 15/11/2028		369 000	376 377	0,11
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,75 %, 15/11/2038		442 000	442 086	0,12
			818 463	0,23
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 4,5 %, 1/05/2025–1/06/2044		2 638 107	2 617 927	0,73
Fannie Mae, 3 %, 1/11/2028–25/05/2053		9 370 161	8 747 980	2,49
Fannie Mae, 2,5 %, 1/11/2031–1/10/2046		1 457 726	1 349 770	0,39
Fannie Mae, 3,5 %, 25/12/2031–25/02/2036(i)		210 650	18 474	0,00
Fannie Mae, 6,5 %, 1/02/2032–1/10/2037		178 672	184 705	0,04
Fannie Mae, 7 %, 25/09/2032		20 287	21 422	0,01
Fannie Mae, 2 %, 25/01/2033–25/04/2046		1 069 671	987 367	0,27
Fannie Mae, 3 %, 25/02/2033 (i)		205 853	17 134	0,00
Fannie Mae, 3,556 %, 25/06/2033		616 440	597 775	0,17
Fannie Mae, 5,5 %, 1/10/2033–1/05/2044		1 336 177	1 373 546	0,38
Fannie Mae, 5 %, 1/04/2034–25/03/2042		1 269 888	1 279 750	0,38
Fannie Mae, 5,909 %, 25/04/2034		72 288	72 245	0,02
Fannie Mae, 6 %, 1/01/2036–1/06/2038		243 153	252 474	0,06

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Government Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Fannie Mae, 5,749 %, 25/01/2036	USD	63 379	63 274	0,02
Fannie Mae, 5,91 %, 15/05/2036		219 152	217 100	0,06
Fannie Mae, 5,859 %, 25/04/2037		30 841	30 271	0,01
Fannie Mae, 5,689 %, 25/05/2037		76 896	75 122	0,02
Fannie Mae, 3,5 %, 1/04/2038–25/06/2048		5 813 325	5 380 365	1,53
Fannie Mae, 4 %, 1/09/2040–1/07/2048		6 402 258	6 145 107	1,73
Fannie Mae, 1 %, 25/03/2041		307 968	264 607	0,07
Fannie Mae, 5,809 %, 25/03/2041–25/03/2046		175 090	173 164	0,04
Fannie Mae, 2,25 %, 25/04/2041–25/07/2043		599 594	543 256	0,16
Fannie Mae, 5,959 %, 25/07/2041		63 491	62 591	0,02
Fannie Mae, 1,75 %, 25/09/2041–25/10/2041		668 428	620 388	0,17
Fannie Mae, 2,75 %, 25/09/2042		226 138	213 713	0,06
Fannie Mae, 5,709 %, 25/09/2045		35 966	35 367	0,01
Fannie Mae, 5,759 %, 25/12/2045		125 174	120 876	0,03
Fannie Mae, UMBS, 4,5 %, 1/09/2024–1/09/2052		921 601	892 912	0,25
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/09/2026–1/11/2053		1 827 921	1 841 545	0,52
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/08/2035–1/07/2052		23 917 709	20 359 467	5,75
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/09/2036–1/05/2052		19 810 499	16 610 683	4,71
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/08/2037–1/05/2053		8 887 513	7 847 347	2,22
Fannie Mae, UMBS, 1,5 %, 1/02/2042–1/04/2052		1 711 059	1 317 551	0,39
Fannie Mae, UMBS, 3,5 %, 1/05/2049–1/08/2052		688 813	630 212	0,19
Fannie Mae, UMBS, 4 %, 1/08/2051–1/12/2052		1 469 666	1 390 692	0,40
Fannie Mae, UMBS, 5 %, 1/08/2052–1/09/2053		2 595 934	2 565 803	0,72
Fannie Mae, UMBS, 6,5 %, 1/01/2053		96 787	99 072	0,03
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/02/2053–1/11/2053		5 253 609	5 333 823	1,51
Freddie Mac, 1,087 %, 25/04/2024 (i)		4 193 207	3 288	0,00
Freddie Mac, 0,773 %, 25/07/2024 (i)		6 533 156	10 180	0,00
Freddie Mac, 3,064 %, 25/08/2024		778 717	768 004	0,22
Freddie Mac, 3,171 %, 25/10/2024		1 110 517	1 093 236	0,31
Freddie Mac, 2,67 %, 25/12/2024		1 828 000	1 790 087	0,51
Freddie Mac, 2,811 %, 25/01/2025		1 168 544	1 143 843	0,32
Freddie Mac, 0,178 %, 25/05/2025 (i)		94 309 473	126 491	0,04
Freddie Mac, 4 %, 1/07/2025–15/01/2055		1 969 935	1 923 924	0,54
Freddie Mac, 4,5 %, 1/07/2025–1/05/2042		1 559 104	1 528 810	0,42
Freddie Mac, 3,5 %, 15/11/2025–1/12/2046		5 887 323	5 591 664	1,57
Freddie Mac, 5,698 %, 25/03/2027		407 301	402 917	0,11
Freddie Mac, 0,704 %, 25/07/2027 (i)		15 320 175	253 907	0,07
Freddie Mac, 0,549 %, 25/08/2027 (i)		13 135 339	170 172	0,05
Freddie Mac, 0,49 %, 25/12/2027 (i)		221 669	2 809	0,00
Freddie Mac, 0,43 %, 25/01/2028 (i)		21 120 341	230 628	0,07
Freddie Mac, 0,436 %, 25/01/2028 (i)		9 103 394	102 623	0,03
Freddie Mac, 0,27 %, 25/02/2028 (i)		25 540 320	143 731	0,04
Freddie Mac, 0,262 %, 25/04/2028 (i)		16 419 391	89 837	0,03
Freddie Mac, 3,9 %, 25/04/2028		308 300	302 585	0,09
Freddie Mac, 3 %, 15/06/2028–25/08/2049		3 643 398	3 343 676	0,96
Freddie Mac, 5,069 %, 25/10/2028		750 000	770 710	0,22
Freddie Mac, 5 %, 25/11/2028–1/12/2044		3 753 943	3 830 340	1,09
Freddie Mac, 4,724 %, 25/12/2028 (i)		962 020	976 063	0,28
Freddie Mac, 5,989 %, 25/03/2029		607 236	606 641	0,17
Freddie Mac, 5,978 %, 25/07/2029–25/09/2029		1 341 629	1 339 641	0,38
Freddie Mac, 5,979 %, 25/08/2029		554 593	553 574	0,16
Freddie Mac, 5,828 %, 25/12/2029		487 500	483 757	0,14
Freddie Mac, 1,44 %, 25/01/2030 (i)		4 376 720	281 192	0,08
Freddie Mac, 1,708 %, 25/01/2030 (i)		5 956 561	456 333	0,13

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Government Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Freddie Mac, 1,21 %, 25/06/2030 (i)	USD	3 280 994	188 361	0,05
Freddie Mac, 1,482 %, 25/06/2030 (i)		9 735 662	674 098	0,19
Freddie Mac, 4,94 %, 25/11/2030		763 833	783 994	0,22
Freddie Mac, 0,627 %, 25/01/2031 (i)		11 566 422	375 572	0,11
Freddie Mac, 0,871 %, 25/02/2032 (i)		11 889 113	599 512	0,17
Freddie Mac, 6,094 %, 25/09/2032		1 620 804	1 622 968	0,46
Freddie Mac, 5,81 %, 15/10/2032		49 192	48 662	0,01
Freddie Mac, 0,301 %, 25/11/2032 (i)		12 148 401	177 935	0,05
Freddie Mac, 0,431 %, 25/05/2033 (i)		10 566 652	254 413	0,07
Freddie Mac, 0,299 %, 25/08/2033 (i)		12 756 058	184 279	0,05
Freddie Mac, 5,5 %, 1/05/2034–1/09/2041		430 899	443 578	0,13
Freddie Mac, 5,66 %, 15/04/2035		40 907	40 413	0,01
Freddie Mac, 6 %, 1/05/2035–1/06/2038		522 841	545 523	0,15
Freddie Mac, 5,5 %, 15/02/2036 (i)		53 174	9 461	0,00
Freddie Mac, 6,5 %, 1/05/2037		5 257	5 540	0,00
Freddie Mac, 5,71 %, 15/03/2039–15/05/2041		507 702	491 245	0,14
Freddie Mac, 6,16 %, 15/05/2039		36 703	36 530	0,01
Freddie Mac, 4,5 %, 15/12/2040 (i)		11 985	955	0,00
Freddie Mac, 1,75 %, 15/08/2041		189 910	175 769	0,05
Freddie Mac, 5,86 %, 15/08/2046		60 283	58 969	0,02
Freddie Mac, 6,794 %, 25/10/2053		112 368	114 253	0,03
Freddie Mac Multi-Family Structured Pass-Through Certificates K-511, "A2", 4,86 %, 25/10/2028		1 874 692	1 911 629	0,54
Freddie Mac Multi-Family Structured Pass-Through Certificates K-511, "X-1", 0,612 %, 25/10/2028 (i)		6 803 072	133 094	0,04
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/08/2036–1/09/2052		4 884 818	4 162 726	1,18
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/09/2036–1/03/2052		12 302 894	9 992 510	2,84
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/04/2037–1/09/2052		4 104 787	3 608 140	1,03
Freddie Mac, UMBS, 4,5 %, 1/03/2038–1/12/2052		718 929	713 473	0,20
Freddie Mac, UMBS, 5,5 %, 1/04/2038–1/09/2053		1 657 545	1 670 269	0,47
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/12/2046–1/05/2052		1 451 400	1 328 420	0,39
Freddie Mac, UMBS, 1,5 %, 1/05/2051		22 753	17 504	0,00
Freddie Mac, UMBS, 4 %, 1/05/2052		472 758	448 009	0,13
Freddie Mac, UMBS, 5 %, 1/10/2052–1/05/2053		791 047	781 581	0,22
Ginnie Mae, 5,5 %, 15/01/2033–20/02/2053		3 052 318	3 080 258	0,87
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/10/2033–20/10/2052		6 170 901	6 038 668	1,72
Ginnie Mae, 5,675 %, 20/08/2034		191 818	196 350	0,06
Ginnie Mae, 5,686 %, 16/04/2037		29 965	29 603	0,01
Ginnie Mae, 6,351 %, 20/08/2038		32 025	32 127	0,01
Ginnie Mae, 4 %, 16/05/2039–20/07/2053		937 324	897 761	0,26
Ginnie Mae, 5 %, 20/08/2039–20/05/2053		4 224 379	4 198 000	1,19
Ginnie Mae, 6,252 %, 16/09/2039		48 468	48 682	0,01
Ginnie Mae, 5,901 %, 20/10/2039		145 683	144 625	0,04
Ginnie Mae, 6,201 %, 20/10/2039		46 757	46 900	0,01
Ginnie Mae, 5,551 %, 20/09/2041		1 651 268	1 620 910	0,46
Ginnie Mae, 3,5 %, 20/10/2041 (i)		54 707	1 751	0,00
Ginnie Mae, 3,5 %, 15/12/2041–20/10/2052		5 213 741	4 831 297	1,37
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/06/2042–20/04/2052		6 870 668	5 941 629	1,69
Ginnie Mae, 4 %, 16/08/2042 (i)		100 374	14 380	0,00
Ginnie Mae, 2,25 %, 20/09/2043		100 619	97 387	0,03
Ginnie Mae, 3 %, 20/04/2045–20/10/2052		5 452 341	4 893 369	1,38
Ginnie Mae, 2 %, 20/01/2052		1 217 638	1 014 338	0,29
Ginnie Mae, 6 %, 20/11/2055		1 357 950	1 381 502	0,39
Ginnie Mae, 0,584 %, 16/02/2059 (i)		402 551	12 381	0,00
Ginnie Mae, TBA, 7 %, 15/02/2054		125 000	128 445	0,04
Ginnie Mae, TBA, 2 %, 20/02/2054		6 278 793	5 228 305	1,48

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Government Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Ginnie Mae, TBA, 6 %, 20/02/2054	USD	675 000	685 295	0,19
UMBS, TBA, 6,5 %, 13/02/2054		325 000	332 691	0,09
UMBS, TBA, 3 %, 25/02/2054		1 050 000	918 914	0,26
UMBS, TBA, 2,5 %, 25/03/2054		200 000	168 371	0,05
			192 258 864	54,45
Obligations municipales				
Chicago, IL, Transit Authority Sales Tax Receipts Refunding Rev., Taxable, "B", 2,064 %, 1/12/2024		377 000	368 236	0,10
Golden State, CA, Tobacco Securitization Corp., Tobacco Settlement Rev., Taxable, "B", 3 %, 1/06/2046		475 000	438 861	0,13
Michigan Finance Authority Tobacco Settlement Asset-Backed Rev., Taxable (2006 Recettes vendues de tabac), "A-1", 2,326 %, 1/06/2030		111 790	109 905	0,03
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,497 %, 1/06/2024		300 000	296 133	0,08
West Virginia Tobacco Settlement Financing Authority Asset-Backed Refunding, Taxable, "A-1", 1,647 %, 1/06/2025		245 000	233 386	0,07
			1 446 521	0,41
Sociétés publiques fédérales américaines et sociétés similaires				
Small Business Administration, 4,77 %, 1/04/2024		5 158	5 141	0,00
Small Business Administration, 4,99 %, 1/09/2024		5 319	5 288	0,00
Small Business Administration, 4,86 %, 1/10/2024		3 484	3 459	0,00
Small Business Administration, 4,86 %, 1/01/2025		5 591	5 532	0,00
Small Business Administration, 5,11 %, 1/04/2025		7 950	7 867	0,00
Small Business Administration, 5,16 %, 1/02/2028		46 981	45 921	0,01
Small Business Administration, 2,21 %, 1/02/2033		146 501	135 216	0,04
Small Business Administration, 2,22 %, 1/03/2033		226 679	208 238	0,06
Small Business Administration, 3,15 %, 1/07/2033		172 052	162 460	0,05
			579 122	0,16
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 6 %, 15/02/2026		62 000	64 172	0,02
Obligations du Trésor américain, 6,75 %, 15/08/2026		614 000	652 879	0,19
Obligations du Trésor américain, 2,25 %, 15/02/2027		5 100 000	4 846 793	1,37
Obligations du Trésor américain, 4,5 %, 15/02/2036		560 000	593 141	0,17
Obligations du Trésor américain, 3,75 %, 15/08/2041		1 538 000	1 442 115	0,41
Obligations du Trésor américain, 3,125 %, 15/02/2043		476 500	402 400	0,11
Obligations du Trésor américain, 2,875 %, 15/05/2043		7 495 400	6 070 688	1,72
Obligations du Trésor américain, 2,5 %, 15/02/2045		10 295 000	7 672 188	2,17
Obligations du Trésor américain, 3 %, 15/11/2045		1 600 000	1 294 000	0,37
Bons du Trésor américain, 2,25 %, 31/03/2024 (g)		22 900 000	22 782 816	6,45
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 31/03/2025		2 478 000	2 457 382	0,70
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 30/04/2025		14 605 000	14 485 193	4,10
Bons du Trésor américain, 0,25 %, 30/09/2025		8 998 000	8 413 833	2,38
Bons du Trésor américain, 2,625 %, 31/12/2025		4 600 000	4 464 516	1,26
Bons du Trésor américain, 3,625 %, 31/03/2028		7 227 000	7 147 955	2,03
Bons du Trésor américain, 2,875 %, 15/05/2028		9 650 000	9 259 477	2,62
Bons du Trésor américain, 2,375 %, 15/05/2029		6 715 000	6 233 409	1,77
Bons du Trésor américain, 3,25 %, 30/06/2029		8 691 000	8 415 672	2,38
Bons du Trésor américain, 2,625 %, 31/07/2029		8 116 000	7 606 531	2,15
Bons du Trésor américain, 1,625 %, 15/08/2029		8 091 000	7 204 783	2,04
Bons du Trésor américain, 1,75 %, 15/11/2029		5 874 000	5 248 281	1,49

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Government Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite			
Obligations du Trésor américain, suite			
Bons du Trésor américain, 3,5 %, 30/04/2030	USD 1 503 000	1 468 243	0,42
		128 226 467	36,32
Total des obligations (coût identifié, 367 341 627 \$)		348 423 660	98,68
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 367 341 627 \$)		348 423 660	98,68
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		4 642 994	1,32
ACTIF NET		353 066 654	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - U.S. Growth Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES			
Aérospatiale et défense			
Howmet Aerospace, Inc.	6 962	391 682	0,69
Industrie de la confection			
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	524	435 811	0,76
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs			
CME Group, Inc.	1 340	275 826	0,49
KKR & Co., Inc.	2 321	200 952	0,35
		476 778	0,84
Services aux entreprises			
CoStar Group, Inc.	7 877	657 572	1,15
MSCI, Inc.	1 598	956 595	1,68
TransUnion	2 595	179 548	0,32
Verisk Analytics, Inc., "A"	4 081	985 684	1,73
		2 779 399	4,88
Logiciels			
Adobe Systems, Inc.	1 121	692 532	1,22
Cadence Design Systems, Inc.	4 278	1 234 032	2,17
Datadog, Inc., "A"	1 146	142 608	0,25
Intuit, Inc.	1 249	788 531	1,38
Microsoft Corp.	13 952	5 547 036	9,73
Synopsys, Inc.	1 988	1 060 300	1,86
		9 465 039	16,61
Logiciels - Systèmes			
Apple, Inc.	17 150	3 162 460	5,55
ServiceNow, Inc.	1 493	1 142 742	2,00
		4 305 202	7,55
Construction			
Martin Marietta Materials, Inc.	451	229 298	0,40
Sherwin-Williams Co.	1 334	406 043	0,71
Vulcan Materials Co.	4 631	1 046 652	1,84
		1 681 993	2,95
Biens de consommation			
Colgate-Palmolive Co.	2 115	178 083	0,31
Estée Lauder Cos., Inc., "A"	1 989	262 528	0,46
		440 611	0,77
Services de consommation			
Uber Technologies, Inc.	7 840	511 717	0,90

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Growth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Équipements électriques			
AMETEK, Inc.	4 241	687 254	1,21
Amphenol Corp., "A"	5 277	533 505	0,94
Rockwell Automation, Inc.	1 113	281 900	0,49
		1 502 659	2,64
Électronique			
Applied Materials, Inc.	1 466	240 864	0,42
ASML Holding N.V., ADR	1 245	1 082 926	1,90
KLA Corp.	806	478 796	0,84
Lam Research Corp.	733	604 850	1,06
Marvell Technology, Inc.	2 095	141 831	0,25
NVIDIA Corp.	7 094	4 364 725	7,66
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	2 724	307 703	0,54
		7 221 695	12,67
Divertissement			
Spotify Technology S.A.	1 894	407 873	0,72
Jeux et hôtellerie			
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	3 573	682 300	1,20
Las Vegas Sands Corp.	2 391	116 968	0,20
		799 268	1,40
Assurances			
Aon PLC	25	7 461	0,01
Arthur J. Gallagher & Co.	1 533	355 901	0,63
		363 362	0,64
Internet			
Alphabet, Inc., "A"	25 229	3 534 583	6,20
Alphabet, Inc., "C"	7 236	1 026 065	1,80
Gartner, Inc.	1 139	521 024	0,92
Meta Platforms, Inc., "A"	7 178	2 800 425	4,91
		7 882 097	13,83
Loisirs et jouets			
Take-Two Interactive Software, Inc.	1 700	280 381	0,49
Machines et outils			
Eaton Corp. PLC	3 648	897 700	1,57
Technologies et services médicaux et de santé			
ICON PLC	765	199 565	0,35
Veeva Systems, Inc.	804	166 758	0,29
		366 323	0,64
Équipements médicaux			
Agilent Technologies, Inc.	1 450	188 645	0,33
Boston Scientific Corp.	19 379	1 225 915	2,15
STERIS PLC	983	215 228	0,38
Thermo Fisher Scientific, Inc.	1 314	708 220	1,24
		2 338 008	4,10
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
Mastercard, Inc., "A"	5 279	2 371 485	4,16
Moody's Corp.	211	82 720	0,15
Visa, Inc., "A"	7 310	1 997 531	3,50
		4 451 736	7,81
Produits pharmaceutiques			
Argenx SE, ADR	297	113 011	0,20
Eli Lilly & Co.	2 351	1 517 829	2,66
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	291	274 349	0,48
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	2 576	1 116 387	1,96
Zoetis, Inc.	1 992	374 118	0,66
		3 395 694	5,96

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Growth Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian Pacific Kansas City Ltd.	779	62 686	0,11
Restaurants			
Chipotle Mexican Grill, Inc., "A"	85	204 745	0,36
Produits chimiques spéciaux			
Air Products & Chemicals, Inc.	467	119 417	0,21
Linde PLC	2 482	1 004 788	1,76
		1 124 205	1,97
Magasins spécialisés			
Amazon.com, Inc.	24 878	3 861 066	6,77
Lululemon Athletica, Inc.	513	232 810	0,41
O'Reilly Automotive, Inc.	429	438 888	0,77
		4 532 764	7,95
Total des actions ordinaires (coût identifié, 43 331 874 \$)		56 319 428	98,81
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 43 331 874 \$) (k)		56 319 428	98,81
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF		675 547	1,19
ACTIF NET		56 994 975	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - U.S. Total Return Bond Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS			
Aérospatiale et défense			
TransDigm, Inc., 4,625 %, 15/01/2029	USD 2 719 000	2 542 455	0,28
Créances adossées à des actifs et titrisées			
ACRES 2021-FL2 Issuer Ltd., "C", FLR, 8,096 %, 15/01/2037	998 000	964 832	0,11
Allegro CLO Ltd., 2014-1RA, "A2", FLR, 7,179 %, 21/10/2028	1 609 799	1 615 655	0,18
Allegro CLO Ltd., 2016-1A, "CR2", 7,575 %, 15/01/2030	3 725 053	3 711 691	0,41
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "C", FLR, 7,448 %, 15/12/2035	323 000	313 926	0,03
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL1, "D", FLR, 8,397 %, 15/12/2035	296 500	290 225	0,03
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL2, "B", FLR, 7,047 %, 15/05/2036	371 500	365 987	0,04
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2021-FL4, "C", FLR, 7,748 %, 15/11/2036	1 095 000	1 062 813	0,12
Arbor Realty Trust, Inc., CLO, 2022-FL1, "D", FLR, 8,346 %, 15/01/2037	2 933 500	2 719 610	0,30
AREIT 2019-CRE3 Trust, "B", FLR, 7,002 %, 14/09/2036	764 500	738 340	0,08
AREIT 2019-CRE3 Trust, "C", FLR, 7,352 %, 14/09/2036	667 000	614 612	0,07
AREIT 2019-CRE3 Trust, "D", FLR, 8,102 %, 14/09/2036	656 000	598 410	0,07
AREIT 2022-CRE6 Trust, "B", FLR, 7,195 %, 20/01/2037	357 000	346 413	0,04
AREIT 2022-CRE6 Trust, "C", FLR, 7,495 %, 20/01/2037	736 500	702 833	0,08
AREIT 2022-CRE6 Trust, "D", FLR, 8,195 %, 20/01/2037	312 000	294 035	0,03
AREIT 2023-CRE8 Trust LLC, "A", FLR, 7,432 %, 17/08/2041	1 849 177	1 843 417	0,21
Bain Capital Credit CLO Ltd., 2023-2A, "B", FLR, 7,897 %, 18/07/2036	3 500 000	3 534 048	0,39
Bain Capital Credit CLO Ltd., 2020-4A, "BR", FLR, 7,818 %, 20/10/2036	4 250 775	4 283 102	0,48
Bayview Commercial Asset Trust, 0 %, 25/12/2036 (i)	60 901	6	0,00
Bayview Financial Revolving Mortgage Loan Trust, FLR, 7,051 %, 28/12/2040	20 071	29 846	0,00
BDS 2021-FL7 Ltd., "B", FLR, 6,949 %, 16/06/2036	408 500	400 118	0,04
Brazos Securitization LLC, 5,413 %, 1/09/2050	1 024 000	1 090 342	0,12
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "C", FLR, 7,747 %, 15/12/2038	267 000	260 436	0,03
BSPRT 2021-FL7 Issuer Ltd., "D", FLR, 8,198 %, 15/12/2038	304 000	287 059	0,03
Business Jet Securities LLC, 2020-1A, "A", 2,981 %, 15/11/2035	181 583	176 021	0,02
Business Jet Securities LLC, 2021-1A, "B", 2,918 %, 15/04/2036	121 068	112 390	0,01

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Total Return Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Créances adossées à des actifs et titrisées, suite				
BXMT 2020-FL2 Ltd., "B", FLR, 6,846 %, 15/02/2038	USD	654 000	568 235	0,06
Capital Automotive, 2020-1A, "A4", REIT, 3,19 %, 15/02/2050		860 695	829 312	0,09
Citigroup Commercial Mortgage Trust, 2016-P6, "A5", 3,72 %, 10/12/2049		1 500 000	1 417 283	0,16
CLNC 2019-FL1 Ltd., "B", FLR, 7,349 %, 20/08/2035		670 000	652 675	0,07
CLNC 2019-FL1 Ltd., "C", FLR, 7,849 %, 20/08/2035		1 087 000	1 060 077	0,12
Commercial Mortgage Pass-Through Certificates, 2014-LC19 "A4", 3,183 %, 10/02/2048		3 819 000	3 733 031	0,42
Commercial Mortgage Trust, 2015-DC1, "A5", 3,35 %, 10/02/2048		4 044 000	3 936 748	0,44
Commercial Mortgage Trust, 2015-LC21, "A4", 3,708 %, 10/07/2048		1 901 154	1 850 341	0,21
Commercial Mortgage Trust, 2015-PC1, "A5", 3,902 %, 10/07/2050		3 754 051	3 674 437	0,41
Commercial Mortgage Trust, 2017-COR2, "A3", 3,51 %, 10/09/2050		3 410 000	3 206 738	0,36
Consumers 2023 Securitization Funding LLC, 5,55 %, 1/03/2028		1 868 000	1 875 505	0,21
Credit Acceptance Auto Loan Trust, 2021-3A, "C", 1,63 %, 16/09/2030		250 000	240 363	0,03
CSAIL Commercial Mortgage Trust, 2015-C2, "A4", 3,504 %, 15/06/2057		600 929	582 993	0,06
Cutwater 2015-1A Ltd., "BR", FLR, 7,375 %, 15/01/2029		2 965 000	2 962 794	0,33
Dryden Senior Loan Fund, 2022-113A, "A1R", CLO, FLR, 7,045 %, 20/10/2035		5 665 544	5 679 034	0,63
Empire District Bondco LLC, 4,943 %, 1/01/2033		1 714 000	1 717 234	0,19
GLGU 2023-1A Ltd., "A", FLR, 7,617 %, 20/07/2035		7 000 000	7 068 642	0,79
Goldentree Loan Management, 2023-17A, "B", FLR, 7,767 %, 20/07/2036		3 000 000	3 026 004	0,34
HarbourView CLO VII Ltd., 7RA, "B", FLR, 7,26 %, 18/07/2031		1 745 000	1 703 776	0,19
Hartwick Park CLO Ltd., 2023-1A, "B", FLR, 7,591 %, 21/01/2036		5 652 174	5 660 042	0,63
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp., 5,708 %, 15/07/2042		1 021	889	0,00
LCCM 2021-FL2 Trust, "C", FLR, 7,598 %, 13/12/2038		629 000	585 084	0,07
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "AS", FLR, 7,198 %, 15/07/2036		1 828 500	1 801 923	0,20
LoanCore 2021-CRE5 Ltd., "B", FLR, 7,448 %, 15/07/2036		662 500	639 845	0,07
LoanCore 2021-CRE6 Ltd., "B", FLR, 7,347 %, 15/11/2038		3 182 500	3 038 966	0,34
MF1 2020-FL4 Ltd., "AS", FLR, 7,546 %, 15/11/2035		1 097 500	1 093 100	0,12
MF1 2022-FL8 Ltd., "C", FLR, 7,536 %, 19/02/2037		769 833	739 465	0,08
MF1 2022-FL8 Ltd., "D", FLR, 7,987 %, 19/02/2037		444 984	419 124	0,05
MF1 2023-FL12 LLC, FLR, "A", 7,401 %, 19/10/2038		4 219 000	4 226 179	0,47
MF1 2024-FL14 LLC, "AS", FLR, 7,658 %, 19/03/2039		2 718 418	2 711 622	0,30
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, 2015-C21, "A4", 3,338 %, 15/03/2048		1 111 591	1 077 852	0,12
Neuberger Berman CLO Ltd., 2023-53A, "B", FLR, 7,589 %, 24/10/2032		3 926 702	3 933 083	0,44
OneMain Financial Issuance Trust 2022-3A, "A", 5,94 %, 15/05/2034		986 000	992 890	0,11
Preferred Term Securities XIX Ltd., CDO, FLR, 5,996 %, 22/12/2035		200 178	182 162	0,02
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "C", FLR, 7,65 %, 25/11/2036		425 000	406 269	0,05
ReadyCap Commercial Mortgage Trust, 2021-FL7, "D", FLR, 8,4 %, 25/11/2036		505 000	470 260	0,05
Residential Funding Mortgage Securities, Inc., FGIC, 3,855 %, 25/12/2035 (d)		3 129	104	0,00
Starwood Commercial Mortgage, 2021-FL2, "C", FLR, 7,549 %, 18/04/2038		652 500	588 590	0,07
Starwood Commercial Mortgage, 2022-FL3, "B", FLR, 7,296 %, 15/11/2038		439 000	426 369	0,05
Starwood Commercial Mortgage, 2022-FL3, "C", FLR, 7,546 %, 15/11/2038		831 500	793 992	0,09
Toyota Lease Owner Trust, 2023-A, "A2", 5,3 %, 20/08/2025		564 333	563 767	0,06
UBS Commercial Mortgage Trust, 2017-C7, "A4", 3,679 %, 15/12/2050		2 000 000	1 851 130	0,21
UBS Commercial Mortgage Trust, 2017-C8, "A4", 3,983 %, 15/02/2051		1 926 975	1 816 320	0,20
Verus Securitization Trust, 2014-1, "A1", 5,712 %, 25/01/2069		1 544 337	1 543 210	0,17
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, 2015-C28, "A4", 3,54 %, 15/05/2048		2 448 036	2 377 468	0,26
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust, 2016-C34, "A4", 3,096 %, 15/06/2049		1 500 000	1 417 006	0,16
			111 498 100	12,42
Industrie automobile				
Stellantis Finance US, Inc., 2,691 %, 15/09/2031		2 000 000	1 675 264	0,19
Radio-télévision				
Discovery Communications LLC, 4,65 %, 15/05/2050		2 020 000	1 624 451	0,18
WarnerMedia Holdings, Inc., 5,05 %, 15/03/2042		2 558 000	2 267 433	0,25
WarnerMedia Holdings, Inc., 5,141 %, 15/03/2052		2 295 000	1 972 707	0,22
WarnerMedia Holdings, Inc., 5,391 %, 15/03/2062		917 000	789 068	0,09

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Total Return Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair		Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Radio-télévision, suite				
WMG Acquisition Corp., 3 %, 15/02/2031	USD	933 000	790 718	0,09
			7 444 377	0,83
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
Charles Schwab Corp., 5,853 % jusqu'au 19/05/2033, FLR jusqu'au 19/05/2034		3 948 000	4 089 684	0,46
Charles Schwab Corp., 5 % jusqu'au 1/06/2027, FLR jusqu'au 1/06/2170		1 941 000	1 804 077	0,20
LPL Holdings, Inc., 6,75 %, 17/11/2028		697 000	732 770	0,08
LPL Holdings, Inc., 4 %, 15/03/2029		2 551 000	2 351 050	0,26
			8 977 581	1,00
Construction				
Standard Industries, Inc., 4,375 %, 15/07/2030		2 791 000	2 536 328	0,28
Standard Industries, Inc., 3,375 %, 15/01/2031		1 975 000	1 679 411	0,19
Vulcan Materials Co., 3,5 %, 1/06/2030		557 000	516 955	0,06
			4 732 694	0,53
Services aux entreprises				
Equinix, Inc., 1,8 %, 15/07/2027		1 182 000	1 072 177	0,12
Equinix, Inc., 2,15 %, 15/07/2030		2 068 000	1 746 744	0,19
Fiserv, Inc., 3,5 %, 1/07/2029		2 110 000	1 979 141	0,22
Fiserv, Inc., 5,6 %, 2/03/2033		2 551 000	2 644 357	0,30
Global Payments, Inc., 2,9 %, 15/05/2030		3 341 000	2 942 401	0,33
Global Payments, Inc., 2,9 %, 15/11/2031		1 173 000	999 768	0,11
Iron Mountain, Inc., 4,5 %, 15/02/2031		2 225 000	1 995 031	0,22
			13 379 619	1,49
Télévision par câble				
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp., 4,5 %, 15/08/2030		3 398 000	2 955 105	0,33
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 6,384 %, 23/10/2035		948 000	955 828	0,11
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital Corp., 5,25 %, 1/04/2053		2 871 000	2 356 498	0,26
CSC Holdings LLC, 4,125 %, 1/12/2030		1 775 000	1 282 438	0,14
CSC Holdings LLC, 4,5 %, 15/11/2031		1 810 000	1 298 768	0,14
Sirius XM Radio, Inc., 5,5 %, 1/07/2029		993 000	943 350	0,11
Sirius XM Radio, Inc., 4,125 %, 1/07/2030		1 610 000	1 408 750	0,16
Time Warner Cable, Inc., 4,5 %, 15/09/2042		1 271 000	1 004 784	0,11
Time Warner Entertainment Co. LP, 8,375 %, 15/07/2033		456 000	522 957	0,06
			12 728 478	1,42
Produits chimiques				
Axalta Coating Systems Ltd., 3,375 %, 15/02/2029		941 000	836 210	0,09
Logiciels				
Dell International LLC/EMC Corp., 5,3 %, 1/10/2029		839 000	860 284	0,10
Logiciels - Systèmes				
SS&C Technologies Holdings, Inc., 5,5 %, 30/09/2027		2 702 000	2 652 386	0,29
Conglomérats				
Regal Rexnord Corp., 6,05 %, 15/04/2028		783 000	794 469	0,09
Regal Rexnord Corp., 6,3 %, 15/02/2030		2 385 000	2 451 517	0,27
Regal Rexnord Corp., 6,4 %, 15/04/2033		3 199 000	3 324 490	0,37
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4,7 %, 15/09/2028		3 585 000	3 550 779	0,40
			10 121 255	1,13
Biens de consommation				
Haleon US Capital LLC, 3,625 %, 24/03/2032		1 030 000	948 366	0,11
Services de consommation				
Match Group Holdings II LLC, 3,625 %, 1/10/2031		2 536 000	2 168 280	0,24
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPF, 0 %, 15/02/2026		562 000	487 432	0,05
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPF, 0 %, 15/02/2029		1 629 000	1 136 592	0,13
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPF, 0 %, 15/02/2031		562 000	336 656	0,04

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS **au 31 janvier 2024**
MFS Meridian Funds - U.S. Total Return Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Services de consommation, suite				
Toll Road Investors Partnership II LP, Appréciation du capital, NPF, 0 %, 15/02/2043	USD	1 796 438	546 836	0,06
			4 675 796	0,52
Équipements électriques				
Arrow Electronics, Inc., 2,95 %, 15/02/2032		5 154 000	4 360 265	0,49
Électronique				
Broadcom, Inc., 3,469 %, 15/04/2034		1 332 000	1 156 970	0,13
Broadcom, Inc., 3,137 %, 15/11/2035		1 195 000	982 312	0,11
Broadcom, Inc., 3,187 %, 15/11/2036		1 148 000	932 563	0,10
			3 071 845	0,34
Énergie - Sociétés indépendantes				
EQT Corp., 3,9 %, 1/10/2027		1 484 000	1 418 570	0,16
EQT Corp., 5 %, 15/01/2029		1 659 000	1 637 966	0,18
EQT Corp., 3,625 %, 15/05/2031		974 000	867 813	0,10
Santos Finance Ltd., 6,875 %, 19/09/2033		2 829 000	3 011 883	0,33
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd., 3,25 %, 15/08/2030		1 063 000	874 902	0,10
			7 811 134	0,87
Énergie - Sociétés intégrées				
Eni S.p.A., 4,25 %, 9/05/2029		3 661 000	3 568 897	0,40
Établissements financiers				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 6,5 %, 15/07/2025		2 357 000	2 390 165	0,27
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3 %, 29/10/2028		1 551 000	1 407 227	0,16
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,3 %, 30/01/2032		1 531 000	1 312 252	0,15
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,125 %, 21/02/2026		1 076 000	1 000 348	0,11
Avolon Holdings Funding Ltd., 4,25 %, 15/04/2026		707 000	683 765	0,07
Avolon Holdings Funding Ltd., 2,75 %, 21/02/2028		1 527 000	1 366 724	0,15
Global Aircraft Leasing Co. Ltd., 6,5 %, 15/09/2024 (p)		1 547 119	1 491 036	0,16
			9 651 517	1,07
Alimentation et boissons				
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 5,45 %, 23/01/2039		2 248 000	2 362 827	0,26
JBS USA Lux S.A./JBS USA Food Co./JBS USA Finance, Inc., 5,5 %, 15/01/2030		2 850 000	2 784 369	0,31
Post Holdings, Inc., 5,5 %, 15/12/2029		732 000	707 560	0,08
Post Holdings, Inc., 4,625 %, 15/04/2030		622 000	572 021	0,07
Post Holdings, Inc., 4,5 %, 15/09/2031		110 000	98 807	0,01
			6 525 584	0,73
Jeux et hôtellerie				
Hyatt Hotels Corp., 5,75 %, 30/01/2027		4 633 000	4 738 826	0,53
Marriott International, Inc., 3,5 %, 15/10/2032		4 860 000	4 333 977	0,48
			9 072 803	1,01
Assurances				
Corebridge Financial, Inc., 3,9 %, 5/04/2032		2 633 000	2 371 829	0,26
Corebridge Financial, Inc., 5,75 %, 15/01/2034		1 580 000	1 620 649	0,18
Corebridge Financial, Inc., 4,35 %, 5/04/2042		383 000	327 815	0,04
Corebridge Financial, Inc., 4,4 %, 5/04/2052		1 125 000	941 625	0,11
			5 261 918	0,59
Assurances - Santé				
Humana, Inc., 5,875 %, 1/03/2033		2 603 000	2 727 117	0,30
Assurances IARD				
Allied World Assurance Co. Holdings Ltd., 4,35 %, 29/10/2025		1 737 000	1 696 255	0,19
Aon Corp., 3,75 %, 2/05/2029		818 000	784 567	0,09
Brown & Brown, Inc., 4,95 %, 17/03/2052		1 152 000	1 027 195	0,11
Fairfax Financial Holdings Ltd., 4,85 %, 17/04/2028		2 771 000	2 744 123	0,31
Fairfax Financial Holdings Ltd., 3,375 %, 3/03/2031		4 503 000	3 954 987	0,44
Liberty Mutual Group, Inc., 3,951 %, 15/10/2050		1 209 000	937 403	0,10
			11 144 530	1,24

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Total Return Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations quasi souveraines du marché international				
Electricité de France S.A., 6,9 %, 23/05/2053	USD	947 000	1 061 223	0,12
Machines et outils				
Ashtead Capital, Inc., 5,8 %, 15/04/2034		985 000	990 536	0,11
CNH Industrial N.V., 3,85 %, 15/11/2027		1 451 000	1 403 296	0,16
			2 393 832	0,27
Grandes banques				
Bank of America Corp., 2,496 % jusqu'au 13/02/2030, FLR jusqu'au 13/02/2031		3 685 000	3 185 906	0,35
Bank of America Corp., 2,572 % jusqu'au 20/10/2031, FLR jusqu'au 20/10/2032		5 460 000	4 551 832	0,51
Bank of America Corp., 5,288 % jusqu'au 25/04/2033, FLR jusqu'au 25/04/2034		1 710 000	1 720 506	0,19
Bank of America Corp., 5,875 % jusqu'au 15/03/2028, FLR jusqu'au 15/09/2171		1 299 000	1 260 030	0,14
Bank of America Corp., 6,1 %, 17/09/2171		873 000	872 460	0,10
Bank of America Corp., 6,5 % jusqu'au 23/10/2024, FLR jusqu'au 23/04/2172		553 000	554 026	0,06
Barclays PLC, 4,375 %, 12/01/2026		948 000	935 710	0,10
Barclays PLC, 4,972 % jusqu'au 16/05/2028, FLR jusqu'au 16/05/2029		976 000	959 970	0,11
Barclays PLC, 2,894 % jusqu'au 24/11/2031, FLR jusqu'au 24/11/2032		3 159 000	2 608 070	0,29
Capital One Financial Corp., 5,817 % jusqu'au 1/02/2033, FLR jusqu'au 1/02/2034		2 553 000	2 550 099	0,28
Capital One Financial Corp., 6,377 % jusqu'au 8/06/2033, FLR jusqu'au 8/06/2034		3 135 000	3 257 363	0,36
Capital One Financial Corp., 6,051 % jusqu'au 1/02/2034, FLR jusqu'au 1/02/2035		316 000	321 121	0,04
Deutsche Bank AG, 2,311 % jusqu'au 16/11/2026, FLR jusqu'au 16/11/2027		2 216 000	2 027 729	0,23
Deutsche Bank AG, 6,72 % jusqu'au 18/01/2028, FLR jusqu'au 18/01/2029		3 421 000	3 561 630	0,40
Goldman Sachs Group, Inc., 2,65 % jusqu'au 21/10/2031, FLR jusqu'au 21/10/2032		5 357 000	4 481 364	0,50
HSBC Holdings PLC, 4,7 % jusqu'au 9/09/2031, FLR jusqu'au 9/09/2169		2 183 000	1 775 344	0,20
HSBC Holdings PLC, 4 % jusqu'au 9/09/2026, FLR jusqu'au 9/09/2170		862 000	787 462	0,09
JPMorgan Chase & Co., 4,203 % jusqu'au 23/07/2028, FLR jusqu'au 23/07/2029		1 320 000	1 284 727	0,14
JPMorgan Chase & Co., 2,956 % jusqu'au 13/05/2030, FLR jusqu'au 13/05/2031		2 429 000	2 143 826	0,24
JPMorgan Chase & Co., 2,545 % jusqu'au 8/11/2031, FLR jusqu'au 8/11/2032		7 173 000	6 015 072	0,67
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2,048 %, 17/07/2030		3 796 000	3 201 901	0,36
Morgan Stanley, 3,125 %, 27/07/2026		1 355 000	1 300 294	0,14
Morgan Stanley, 5,449 % jusqu'au 20/07/2028, FLR jusqu'au 20/07/2029		630 000	641 204	0,07
Morgan Stanley, 2,699 % jusqu'au 22/01/2030, FLR jusqu'au 22/01/2031		722 000	634 383	0,07
Morgan Stanley, 2,511 % jusqu'au 20/10/2031, FLR jusqu'au 20/10/2032		2 990 000	2 490 293	0,28
Morgan Stanley, 5,424 % jusqu'au 21/07/2033, FLR jusqu'au 21/07/2034		1 494 000	1 513 352	0,17
NatWest Group PLC, 6,016 % jusqu'au 2/03/2033, FLR jusqu'au 2/03/2034		854 000	893 027	0,10
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 2,13 %, 8/07/2030		3 751 000	3 165 733	0,35
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 0,85 %, 25/03/2024		1 234 000	1 225 728	0,14
UBS Group AG, 4,375 % jusqu'au 10/02/2031, FLR jusqu'au 10/08/2171		3 034 000	2 405 639	0,27
UBS Group Funding (Jersey) Ltd., 4,125 %, 24/09/2025		2 814 000	2 760 398	0,31
Wells Fargo & Co., 2,572 % jusqu'au 11/02/2030, FLR jusqu'au 11/02/2031		3 839 000	3 340 324	0,37
Westpac Banking Corp., 2,894 % jusqu'au 4/02/2025, FLR jusqu'au 4/02/2030		756 000	733 395	0,08
			69 159 918	7,71
Technologies et services médicaux et de santé				
Adventist Health System/West, 5,43 %, 1/03/2032		1 339 000	1 364 426	0,15
Alcon Finance Corp., 2,75 %, 23/09/2026		419 000	396 408	0,04
Alcon Finance Corp., 3 %, 23/09/2029		2 409 000	2 197 017	0,25
Alcon Finance Corp., 2,6 %, 27/05/2030		455 000	398 098	0,05
Alcon Finance Corp., 5,375 %, 6/12/2032		382 000	392 843	0,04
HCA, Inc., 4,375 %, 15/03/2042		1 040 000	889 145	0,10
Marin General Hospital, 7,242 %, 1/08/2045		1 087 000	1 155 440	0,13
Northwell Healthcare, Inc., 3,979 %, 1/11/2046		396 000	322 389	0,04
ProMedica Toledo Hospital, "B", 5,325 %, 15/11/2028		2 461 000	2 282 577	0,25
ProMedica Toledo Hospital, "B", AGM, 5,75 %, 15/11/2038		969 000	969 188	0,11
Tower Health, 4,451 %, 1/02/2050		2 362 000	1 089 609	0,12
			11 457 140	1,28
Métaux et exploitation minière				
Anglo American Capital PLC, 2,25 %, 17/03/2028		2 273 000	2 027 694	0,23

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS

au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Total Return Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Métaux et exploitation minière, suite				
Anglo American Capital PLC, 3,875 %, 16/03/2029	USD	1 761 000	1 656 801	0,18
Anglo American Capital PLC, 2,875 %, 17/03/2031		1 820 000	1 548 282	0,17
Anglo American Capital PLC, 4,75 %, 16/03/2052		1 861 000	1 608 189	0,18
FMG Resources Ltd., 4,375 %, 1/04/2031		2 108 000	1 897 186	0,21
Glencore Funding LLC, 2,85 %, 27/04/2031		4 241 000	3 665 629	0,41
Novelis Corp., 3,875 %, 15/08/2031		1 445 000	1 253 301	0,14
			13 657 082	1,52
Secteur intermédiaire				
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, 31/12/2039		1 205 000	961 978	0,11
Cheniere Energy Partners LP, 4,5 %, 1/10/2029		613 000	584 790	0,06
Enbridge, Inc., 4,25 %, 1/12/2026		1 705 000	1 683 961	0,19
Enbridge, Inc., 5,7 %, 8/03/2033		2 169 000	2 237 628	0,25
Energy Transfer LP, 5,55 %, 15/02/2028		853 000	868 010	0,10
Energy Transfer LP, 5,75 %, 15/02/2033		2 166 000	2 218 107	0,25
Kinder Morgan Energy Partners LP, 5,4 %, 1/09/2044		1 440 000	1 349 571	0,15
MPLX LP, 4,95 %, 14/03/2052		2 025 000	1 799 244	0,20
Plains All American Pipeline LP, 3,55 %, 15/12/2029		4 072 000	3 747 272	0,42
Sabine Pass Liquefaction LLC, 4,5 %, 15/05/2030		2 866 000	2 797 703	0,31
Targa Resources Corp., 4,2 %, 1/02/2033		404 000	369 827	0,04
Targa Resources Corp., 6,125 %, 15/03/2033		2 501 000	2 617 175	0,29
Targa Resources Corp., 4,95 %, 15/04/2052		669 000	583 438	0,06
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 6,25 %, 15/01/2030		2 301 000	2 302 827	0,26
			24 121 531	2,69
Titres adossés à des hypothèques				
Fannie Mae, 5 %, 1/03/2024–1/03/2042		650 632	656 005	0,05
Fannie Mae, 4,5 %, 1/05/2024–1/06/2044		2 159 081	2 140 517	0,24
Fannie Mae, 5,5 %, 1/07/2024–1/04/2040		660 104	678 808	0,07
Fannie Mae, 4,54 %, 1/07/2026		541 805	541 441	0,06
Fannie Mae, 3,95 %, 1/01/2027		108 370	106 824	0,01
Fannie Mae, 3 %, 1/11/2028–1/10/2046		1 342 383	1 228 585	0,14
Fannie Mae, 2,5 %, 1/11/2031–1/11/2046		264 789	229 483	0,02
Fannie Mae, 6,5 %, 1/01/2033		1 108	1 147	0,00
Fannie Mae, 4,35 %, 1/02/2033		3 900 000	3 854 314	0,43
Fannie Mae, 3 %, 25/02/2033(i)		108 543	8 914	0,00
Fannie Mae, 6 %, 1/09/2034–1/06/2038		231 500	240 628	0,02
Fannie Mae, 3,5 %, 1/04/2038–1/04/2049		2 276 491	2 128 144	0,25
Fannie Mae, 3,25 %, 25/05/2040		29 978	27 770	0,00
Fannie Mae, 4 %, 1/09/2040–1/07/2048		3 564 058	3 421 970	0,37
Fannie Mae, 2 %, 25/04/2046		65 700	59 619	0,01
Fannie Mae, 4 %, 25/07/2046 (i)		121 136	22 568	0,00
Fannie Mae, UMBS, 5,5 %, 1/07/2026–1/10/2053		3 433 981	3 451 189	0,38
Fannie Mae, UMBS, 2 %, 1/04/2035–1/05/2052		26 324 975	22 071 948	2,47
Fannie Mae, UMBS, 2,5 %, 1/04/2037–1/02/2053		32 792 831	27 800 636	3,12
Fannie Mae, UMBS, 3 %, 1/02/2038–1/07/2052		12 543 959	11 036 531	1,25
Fannie Mae, UMBS, 1,5 %, 1/02/2042		40 747	33 329	0,00
Fannie Mae, UMBS, 3,5 %, 1/05/2049–1/10/2052		5 702 946	5 199 558	0,58
Fannie Mae, UMBS, 4,5 %, 1/06/2052–1/07/2053		7 575 953	7 329 798	0,82
Fannie Mae, UMBS, 5 %, 1/12/2052–1/05/2053		3 299 570	3 259 278	0,36
Fannie Mae, UMBS, 6 %, 1/02/2053–1/11/2053		1 142 058	1 163 548	0,13
Fannie Mae, UMBS, 4 %, 1/03/2053–1/04/2053		539 957	508 282	0,06
Fannie Mae, UMBS, 6,5 %, 1/12/2053–1/01/2054		2 762 646	2 827 855	0,31
Freddie Mac, 2,67 %, 25/12/2024		1 482 000	1 451 263	0,16
Freddie Mac, 2,811 %, 25/01/2025		868 316	849 961	0,10
Freddie Mac, 4 %, 1/07/2025–1/01/2041		312 083	301 573	0,04

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Total Return Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Titres adossés à des hypothèques, suite				
Freddie Mac, 4,5 %, 1/07/2025–1/05/2042	USD	544 649	542 216	0,06
Freddie Mac, 3 %, 15/06/2028–1/10/2046		3 354 338	3 023 988	0,34
Freddie Mac, 4,06 %, 25/10/2028		512 000	504 295	0,06
Freddie Mac, 6 %, 1/08/2034–1/11/2037		13 955	14 522	0,00
Freddie Mac, 5,5 %, 1/06/2035–1/01/2038		50 580	52 032	0,00
Freddie Mac, 5 %, 1/11/2035–1/07/2041		266 165	268 786	0,02
Freddie Mac, 5,5 %, 15/02/2036 (i)		22 049	3 923	0,00
Freddie Mac, 3,5 %, 1/11/2037–1/11/2047		2 703 224	2 519 112	0,28
Freddie Mac, 4,5 %, 15/12/2040 (i)		12 424	990	0,00
Freddie Mac, UMBS, 3 %, 1/11/2034–1/06/2052		6 034 050	5 375 995	0,60
Freddie Mac, UMBS, 2 %, 1/11/2036–1/03/2052		14 862 327	12 367 677	1,39
Freddie Mac, UMBS, 2,5 %, 1/03/2037–1/07/2053		8 569 235	7 258 700	0,80
Freddie Mac, UMBS, 4,5 %, 1/06/2038–1/07/2053		8 220 351	8 040 482	0,91
Freddie Mac, UMBS, 3,5 %, 1/12/2046–1/12/2052		1 575 287	1 440 715	0,16
Freddie Mac, UMBS, 5,5 %, 1/08/2052–1/09/2053		3 087 551	3 103 985	0,34
Freddie Mac, UMBS, 5 %, 1/09/2052–1/07/2053		6 887 679	6 803 347	0,74
Freddie Mac, UMBS, 4 %, 1/10/2052–1/02/2053		1 834 569	1 726 958	0,19
Freddie Mac, UMBS, 6 %, 1/12/2052–1/10/2053		1 686 569	1 724 050	0,20
Ginnie Mae, 4,5 %, 20/10/2033–20/04/2053		5 675 646	5 549 384	0,59
Ginnie Mae, 6 %, 20/01/2036–15/01/2039		33 202	34 489	0,00
Ginnie Mae, 5,5 %, 15/04/2038–20/04/2053		4 623 375	4 657 648	0,52
Ginnie Mae, 4 %, 20/10/2040–20/01/2054		4 566 214	4 340 902	0,50
Ginnie Mae, 3,5 %, 15/12/2041–20/10/2052		3 439 707	3 198 785	0,37
Ginnie Mae, 3 %, 20/11/2044–20/10/2052		5 373 838	4 816 148	0,53
Ginnie Mae, 2,5 %, 20/08/2051–20/06/2052		7 251 318	6 269 480	0,70
Ginnie Mae, 2 %, 20/03/2052–20/04/2052		5 962 271	4 963 401	0,56
Ginnie Mae, 5 %, 20/12/2052–20/10/2053		11 136 176	11 060 518	1,23
Ginnie Mae, TBA, 7 %, 15/02/2054		175 000	179 823	0,02
Ginnie Mae, TBA, 6 %, 20/02/2054		2 150 000	2 182 792	0,24
Ginnie Mae, TBA, 6,5 %, 20/02/2054–20/03/2054		1 750 000	1 787 807	0,20
UMBS, TBA, 2 %, 25/02/2039–25/03/2039		4 050 000	3 638 362	0,40
UMBS, TBA, 2,5 %, 25/02/2039–25/03/2054		5 100 000	4 522 568	0,51
UMBS, TBA, 5 %, 18/03/2039		1 425 000	1 429 286	0,16
UMBS, TBA, 6,5 %, 13/02/2054		900 000	921 299	0,10
UMBS, TBA, 3 %, 25/02/2054		4 800 000	4 200 750	0,47
UMBS, TBA, 3,5 %, 25/02/2054–25/03/2054		4 800 000	4 369 493	0,49
UMBS, TBA, 5,5 %, 25/02/2054		2 725 000	2 732 756	0,30
			228 258 950	25,43
Obligations municipales				
Bridgeview, IL, Stadium and Redevelopment Projects, Taxable, AAC, 5,06 %, 1/12/2025		120 000	118 433	0,01
Bridgeview, IL, Stadium and Redevelopment Projects, Taxable, AAC, 5,14 %, 1/12/2036		2 640 000	2 368 539	0,27
Escambia County, FL, Health Facilities Authority Rev., Taxable (Baptist Health Care Corp.), "B", AGM, 3,607 %, 15/08/2040		490 000	393 111	0,04
Jacksonville, AL, Public Educational Construction Authority Higher Education Facilities Rev. (Jacksonville State University Foundation), "B", AGM, 7 %, 1/08/2046		1 365 000	1 483 823	0,17
Oklahoma Development Finance Authority, Health System Rev., Taxable (OU Medicine Project), "C", 5,45 %, 15/08/2028		923 000	832 388	0,09
Philadelphia, PA, School District, Taxable, "B", AGM, 6,615 %, 1/06/2030		945 000	1 015 017	0,11
État de Floride, Taxable, "A", 2,154 %, 1/07/2030		2 174 000	1 857 312	0,21
			8 068 623	0,90
Gaz naturel - Distribution				
NiSource, Inc., 3,6 %, 1/05/2030		833 000	776 295	0,09
Autres banques et établissements financiers diversifiés				
BPCE S.A., 4,5 %, 15/03/2025		1 756 000	1 728 317	0,19
Discover Financial Services, 6,7 %, 29/11/2032		3 296 000	3 452 464	0,38

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Total Return Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Autres banques et établissements financiers diversifiés, suite				
Macquarie Bank Ltd. of London, 6,125 % jusqu'au 8/03/2027, FLR jusqu'au 31/12/2165	USD	991 000	943 212	0,11
Macquarie Group Ltd., 4,442 % jusqu'au 21/06/2032, FLR jusqu'au 21/06/2033		6 423 000	5 988 673	0,67
			12 112 666	1,35
Produits pharmaceutiques				
Organon Finance 1 LLC, 4,125 %, 30/04/2028		1 650 000	1 509 667	0,17
Immobilier - Bureaux				
Boston Properties LP, REIT, 2,55 %, 1/04/2032		5 910 000	4 700 185	0,52
Distribution				
Penske Automotive Group Co., 3,75 %, 15/06/2029		2 613 000	2 328 771	0,26
Produits chimiques spéciaux				
International Flavors & Fragrances, Inc., 2,3 %, 1/11/2030		3 309 000	2 754 273	0,31
Magasins spécialisés				
DICK'S Sporting Goods, 3,15 %, 15/01/2032		5 225 000	4 442 617	0,49
Télécommunications mobiles				
Rogers Communications, Inc., 4,5 %, 15/03/2042		3 467 000	3 080 545	0,34
Rogers Communications, Inc., 4,55 %, 15/03/2052		3 471 000	2 982 878	0,33
SBA Communications Corp., 3,125 %, 1/02/2029		1 785 000	1 590 851	0,18
T-Mobile USA, Inc., 2,55 %, 15/02/2031		6 175 000	5 294 338	0,59
T-Mobile USA, Inc., 4,375 %, 15/04/2040		125 000	112 804	0,01
Vodafone Group PLC, 5,625 %, 10/02/2053		876 000	882 490	0,10
			13 943 906	1,55
Tabac				
B.A.T. Capital Corp., 4,906 %, 2/04/2030		372 000	367 058	0,04
B.A.T. Capital Corp., 4,742 %, 16/03/2032		3 093 000	2 961 238	0,33
B.A.T. International Finance PLC, 4,448 %, 16/03/2028		2 981 000	2 915 826	0,33
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 17/11/2027		1 436 000	1 459 505	0,16
Philip Morris International, Inc., 5,625 %, 17/11/2029		1 226 000	1 279 511	0,14
Philip Morris International, Inc., 5,125 %, 15/02/2030		2 120 000	2 154 931	0,24
			11 138 069	1,24
Transports - Services				
Element Fleet Management Corp., 1,6 %, 6/04/2024		1 388 000	1 376 679	0,15
ERAC USA Finance LLC, 7 %, 15/10/2037		1 008 000	1 177 655	0,13
			2 554 334	0,28
Sociétés publiques fédérales américaines et sociétés similaires				
Small Business Administration, 4,34 %, 1/03/2024		194	194	0,00
Small Business Administration, 5,52 %, 1/06/2024		114	113	0,00
Small Business Administration, 5,19 %, 1/07/2024		141	140	0,00
Small Business Administration, 4,86 %, 1/10/2024		224	222	0,00
Small Business Administration, 4,57 %, 1/06/2025		1 597	1 585	0,00
Small Business Administration, 4,76 %, 1/09/2025		4 436	4 364	0,00
Small Business Administration, 5,35 %, 1/02/2026		4 784	4 730	0,00
Small Business Administration, 4,43 %, 1/05/2029		37 448	36 672	0,00
Small Business Administration, 3,25 %, 1/11/2030		59 023	56 518	0,01
Small Business Administration, 2,85 %, 1/09/2031		102 702	96 804	0,01
Small Business Administration, 2,37 %, 1/08/2032		129 045	118 480	0,01
Small Business Administration, 2,13 %, 1/01/2033		294 738	268 989	0,03
Small Business Administration, 2,21 %, 1/02/2033		80 095	73 925	0,01
Small Business Administration, 2,22 %, 1/03/2033		255 443	234 662	0,03
Small Business Administration, 2,08 %, 1/04/2033		387 858	353 867	0,04
Small Business Administration, 2,45 %, 1/06/2033		371 357	341 266	0,04
Small Business Administration, 3,62 %, 1/09/2033		91 545	88 159	0,01
			1 680 690	0,19
Obligations du Trésor américain				
Obligations du Trésor américain, 1,125 %, 15/08/2040		4 000 000	2 513 594	0,28
Obligations du Trésor américain, 1,375 %, 15/11/2040		3 500 000	2 286 484	0,25

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Total Return Bond Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
OBLIGATIONS, suite				
Obligations du Trésor américain, suite				
Obligations du Trésor américain, 1,75 %, 15/08/2041	USD	4 700 000	3 225 926	0,36
Obligations du Trésor américain, 4 %, 15/11/2042		26 957 000	25 877 667	2,88
Obligations du Trésor américain, 4,375 %, 15/08/2043		15 000 000	15 107 812	1,68
Obligations du Trésor américain, 2,875 %, 15/11/2046		2 800 000	2 198 875	0,25
Obligations du Trésor américain, 1,625 %, 15/11/2050		26 800 000	15 431 984	1,72
Obligations du Trésor américain, 2,25 %, 15/02/2052		12 942 000	8 686 812	0,97
Obligations du Trésor américain, 4 %, 15/11/2052		4 500 000	4 323 516	0,48
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 31/03/2025		46 845 000	46 455 235	5,18
Bons du Trésor américain, 5 %, 31/08/2025		32 100 000	32 397 176	3,61
Bons du Trésor américain, 4,25 %, 31/12/2025		15 800 000	15 801 234	1,76
Bons du Trésor américain, 3,875 %, 31/12/2027		24 000 000	23 953 125	2,67
Bons du Trésor américain, 4,125 %, 31/07/2028		13 500 000	13 628 145	1,52
			211 887 585	23,61
Services publics - Énergie électrique				
AEP Transmission Co. LLC, 4 %, 1/12/2046		2 910 000	2 422 856	0,27
American Electric Power Co., Inc., 5,95 %, 1/11/2032		1 106 000	1 166 751	0,13
Calpine Corp., 3,75 %, 1/03/2031		2 140 000	1 859 031	0,21
Enel Finance International N.V., 3,5 %, 6/04/2028		4 661 000	4 393 436	0,49
Jersey Central Power & Light Co., 2,75 %, 1/03/2032		1 708 000	1 439 578	0,16
Pacific Gas & Electric Co., 3 %, 15/06/2028		847 000	777 125	0,08
Pacific Gas & Electric Co., 3,3 %, 1/08/2040		2 024 000	1 498 895	0,17
			13 557 672	1,51
Total des obligations (coût identifié, 918 061 795 \$)			887 833 504	98,93
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 2 161 000 \$)	USD	2 161 000	2 160 688	0,24
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 920 222 795 \$) (k)			889 994 192	99,17
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			7 483 650	0,83
ACTIF NET			897 477 842	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

MFS Meridian Funds - U.S. Value Fund

(en dollars US)

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES				
Aérospatiale et défense				
General Dynamics Corp.		167 500	44 385 825	2,44
Honeywell International, Inc.		152 503	30 845 257	1,70
Northrop Grumman Corp.		86 054	38 445 485	2,11
RTX Corp.		436 887	39 809 143	2,19
			153 485 710	8,44
Boissons alcoolisées				
Diageo PLC		647 841	23 300 771	1,28
Sociétés de courtage et gestionnaires d'actifs				
BlackRock, Inc.		25 700	19 899 767	1,09
Citigroup, Inc.		455 736	25 598 691	1,41
KKR & Co., Inc.		192 873	16 698 944	0,92
NASDAQ, Inc.		462 698	26 730 064	1,47
			88 927 466	4,89
Services aux entreprises				
Accenture PLC, "A"		107 310	39 047 963	2,14

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS **au 31 janvier 2024**
MFS Meridian Funds - U.S. Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Services aux entreprises, suite			
Equifax, Inc.	75 033	18 333 563	1,01
		57 381 526	3,15
Télévision par câble			
Charter Communications, Inc., "A"	32 532	12 059 938	0,66
Comcast Corp., "A"	1 042 437	48 515 018	2,67
		60 574 956	3,33
Produits chimiques			
PPG Industries, Inc.	91 834	12 952 267	0,71
Construction			
Otis Worldwide Corp.	67 384	5 959 441	0,33
Sherwin-Williams Co.	43 320	13 185 742	0,72
		19 145 183	1,05
Biens de consommation			
Kenvue, Inc. (I)	966 247	20 059 288	1,10
Kimberly-Clark Corp.	106 653	12 901 813	0,71
Reckitt Benckiser Group PLC	84 663	6 113 702	0,34
		39 074 803	2,15
Équipements électriques			
Johnson Controls International PLC	205 999	10 854 087	0,60
Électronique			
Analog Devices, Inc.	184 126	35 418 477	1,95
KLA Corp.	49 877	29 628 933	1,63
NXP Semiconductors N.V.	95 112	20 027 734	1,10
Texas Instruments, Inc.	158 637	25 400 957	1,39
		110 476 101	6,07
Énergie - Sociétés indépendantes			
ConocoPhillips	422 418	47 255 902	2,60
EOG Resources, Inc.	134 330	15 285 411	0,84
Pioneer Natural Resources Co.	119 839	27 542 597	1,51
		90 083 910	4,95
Énergie - Sociétés intégrées			
Chevron Corp.	111 053	16 372 544	0,90
Alimentation et boissons			
Mondelez International, Inc.	60 046	4 519 662	0,25
Nestlé S.A.	240 406	27 410 755	1,51
PepsiCo, Inc.	134 409	22 651 949	1,24
		54 582 366	3,00
Jeux et hôtellerie			
Marriott International, Inc., "A"	116 525	27 934 538	1,54
Organisations de soins de santé intégrés			
Cigna Group	173 068	52 084 815	2,86
Elevance Health, Inc.	30 359	14 980 345	0,83
		67 065 160	3,69
Assurances			
Aon PLC	134 131	40 028 714	2,20
Chubb Ltd.	148 993	36 503 285	2,01
Marsh & McLennan Cos., Inc.	232 349	45 038 530	2,47
Progressive Corp.	319 691	56 984 921	3,13
Travelers Cos., Inc.	154 761	32 710 285	1,80
		211 265 735	11,61
Machines et outils			
Eaton Corp. PLC	98 665	24 279 483	1,33
Illinois Tool Works, Inc.	86 225	22 496 102	1,24
PACCAR, Inc.	125 159	12 564 712	0,69
Trane Technologies PLC	61 433	15 484 188	0,85

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Value Fund, suite

Nom du titre Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé	Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
ACTIONS ORDINAIRES, suite			
Machines et outils, suite			
Veralto Corp.	11 308	867 211	0,05
		75 691 696	4,16
Grandes banques			
JPMorgan Chase & Co.	475 064	82 832 159	4,55
Morgan Stanley	385 528	33 633 463	1,85
PNC Financial Services Group, Inc.	131 956	19 953 067	1,10
		136 418 689	7,50
Technologies et services médicaux et de santé			
McKesson Corp.	88 113	44 046 808	2,42
Équipements médicaux			
Abbott Laboratories	171 935	19 454 445	1,07
Boston Scientific Corp.	188 994	11 955 761	0,66
Medtronic PLC	119 687	10 477 400	0,57
		41 887 606	2,30
Autres banques et établissements financiers diversifiés			
American Express Co.	180 320	36 197 437	1,99
Produits pharmaceutiques			
AbbVie, Inc.	143 146	23 533 202	1,30
Johnson & Johnson	256 495	40 757 055	2,24
Merck & Co., Inc.	218 720	26 417 002	1,45
Pfizer, Inc.	1 020 401	27 632 459	1,52
Roche Holding AG	19 275	5 507 209	0,30
		123 846 927	6,81
Chemins de fer et transport maritime			
Canadian National Railway Co.	86 187	10 690 635	0,59
Union Pacific Corp.	159 058	38 799 018	2,13
		49 489 653	2,72
Immobilier			
Prologis, Inc., REIT	255 402	32 356 879	1,78
Public Storage, Inc., REIT	22 278	6 308 907	0,35
		38 665 786	2,13
Produits chimiques spéciaux			
Corteva, Inc.	191 135	8 692 820	0,48
DuPont de Nemours, Inc.	344 004	21 259 447	1,17
		29 952 267	1,65
Magasins spécialisés			
Lowe's Cos., Inc.	170 218	36 229 199	1,99
Target Corp.	171 689	23 878 506	1,31
		60 107 705	3,30
Services publics - Énergie électrique			
American Electric Power Co., Inc.	105 927	8 277 136	0,45
Dominion Energy, Inc.	458 622	20 968 198	1,15
Duke Energy Corp.	335 962	32 195 238	1,77
Exelon Corp.	394 938	13 747 792	0,76
PG&E Corp.	783 608	13 219 467	0,73
Southern Co.	462 814	32 174 829	1,77
Xcel Energy, Inc.	246 507	14 758 374	0,81
		135 341 034	7,44
Total des actions ordinaires (coût identifié, 1 516 272 909 \$)		1 815 122 731	99,78

TABLEAUX DES INVESTISSEMENTS au 31 janvier 2024

MFS Meridian Funds - U.S. Value Fund, suite

Nom du titre		Actions/Pair	Valeur de marché (\$)	Actif net (%)
Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé				
OBLIGATIONS À COURT TERME (y)				
Federal Home Loan Bank, 5,18 %, 1/02/2024 (coût identifié, 607 000 \$)	USD	607 000	606 912	0,04
Total des valeurs mobilières et instruments du marché monétaire négociés sur un marché réglementé (coût identifié, 1 516 879 909 \$) (k)			1 815 729 643	99,82
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF, MOINS LE PASSIF			3 353 224	0,18
ACTIF NET			1 819 082 867	100,00

Voir les notes de bas de page des Tableaux des investissements et les Notes aux états financiers

Notes de bas de page des Tableaux des investissements :

Imposable : Titre non exonéré des impôts fédéraux américains

(b) Valeurs mobilières négociées sur d'autres marchés réglementés.

(c) Autres valeurs mobilières, actuellement non négociées sur un marché réglementé. Classées comme titres illiquides, voir la Note 17.

(d) En défaut.

(g) La totalité ou une partie du titre a été isolée comme garantie au titre des contrats de change à terme ouverts.

(i) Certificat de coupon pour lequel le compartiment reçoit les intérêts sur le principal notionnel (montant nominal). Le montant au pair indiqué est le principal notionnel et ne correspond pas au coût du titre.

(k) Au 31 Janvier 2024, les compartiments suivants détenaient des titres qui étaient valorisés à leur juste valeur conformément aux politiques adoptées par le Conseil d'administration :

Compartiment	Valeur de marché	% de la valeur totale de marché du compartiment	Nombre de titres
Asia Ex-Japan Fund	24 910 805 \$	73,68 %	39
Blended Research European Equity Fund	5 242 713 €	65,11 %	51
Continental European Equity Fund	51 369 464 €	66,98 %	33
Contrarian Value Fund	361 109 074 \$	56,61 %	21
Diversified Income Fund	4 660 910 \$	6,59 %	38
Emerging Markets Equity Fund	47 664 408 \$	61,28 %	45
Emerging Markets Equity Research Fund	1 358 684 \$	49,41 %	24
Euro Credit Fund	249 600 €	0,15 %	1
European Core Equity Fund	85 437 038 €	65,22 %	47
European Research Fund	787 971 194 €	70,05 %	46
European Smaller Companies Fund	91 118 021 €	49,70 %	37
European Value Fund	1 879 063 836 €	61,54 %	37
Global Concentrated Fund	180 792 163 €	31,92 %	9
Global Credit Fund	140 266 \$	0,15 %	1
Global Equity Fund	1 023 827 390 \$	32,87 %	30
Global Equity Income Fund	2 324 558 \$	34,60 %	36
Global High Yield Fund	811 222 \$	0,36 %	3
Global Intrinsic Value Fund	21 648 117 \$	30,92 %	42
Global Listed Infrastructure Fund	621 509 \$	27,62 %	14
Global New Discovery Fund	1 953 033 \$	34,28 %	36
Global Opportunistic Bond Fund	936 086 \$	0,22 %	3
Global Research Focused Fund	35 494 653 \$	27,57 %	16
Global Strategic Equity Fund	666 883 \$	19,97 %	9
Global Total Return Fund	302 088 409 \$	20,50 %	60
Japan Equity Fund	434 572 547 ¥	92,10 %	51
Limited Maturity Fund	7 285 423 \$	0,65 %	3
Managed Wealth Fund	2 984 450 \$	23,35 %	55
Prudent Capital Fund	1 196 155 936 \$	38,15 %	21
Prudent Wealth Fund	1 178 977 043 \$	43,23 %	32
U.K. Equity Fund	10 928 397 £	66,66 %	31
U.S. Concentrated Growth Fund	9 384 079 \$	2,05 %	1
U.S. Growth Fund	435 811 \$	0,77 %	1
U.S. Total Return Bond Fund	2 711 622 \$	0,30 %	1
U.S. Value Fund	62 332 437 \$	3,43 %	4

(l) Une partie de ce titre est actuellement prêtée. Voir la note 4 pour de plus amples informations.

(p) Titre à rendement réinvesti (PIK) pour lequel des intérêts peuvent être perçus sous forme d'espèces et/ou de titres supplémentaires.

(v) Le taux indiqué correspond au rendement annualisé du compartiment sur sept jours en fin de période et peut être négatif (c'est-à-dire que les coûts et dépenses du compartiment peuvent dépasser les revenus et les plus-values de son portefeuille).

(y) Le taux indiqué représente un rendement annualisé au moment de l'achat.

Les abréviations suivantes sont utilisées dans ce rapport et sont définies comme suit :

ADR	Certificat de dépôt américain
AGM	Assured Guaranty Municipal
CDO	Obligation garantie par des créances
CLO	Obligation garantie par des prêts
CPI	Indice des prix à la consommation
ETC	Matières premières négociées en bourse
ETF	Fonds négocié en Bourse
FLR	Taux flottant. Le taux de la fin de la période publié peut ne pas correspondre au taux actuel.
GDR	Certificat de dépôt mondial
IEU	Unités de valeur internationales
REIT	Société de placement immobilier
TBA	À communiquer ultérieurement
TIPS	Titre du Trésor protégé contre l'inflation
UMBS	Titres adossés à des créances hypothécaires uniformes

Des codes de devises ont été utilisés tout au long du présent rapport. Voici la liste des codes de devises :

AUD	Dollar australien
BRL	Réal brésilien
CAD	Dollar canadien
CHF	Franc suisse
CLP	Peso chilien
CNH	Yuan Renminbi chinois (offshore)
CNY	China Yuan Renminbi
COP	Peso colombien
CZK	Couronne tchèque
DKK	Couronne danoise
EUR	Euro
GBP	Livre sterling
HUF	Forint hongrois
IDR	Roupie indonésienne
INR	Roupie indienne
ISK	Couronne islandaise
JPY	Yen japonais
KRW	Won sud-coréen
MXN	Peso mexicain
MYR	Ringgit malaisien
NOK	Couronne norvégienne
NZD	Dollar néo-zélandais
PEN	Nouveau sol péruvien
PHP	Peso philippin
PLN	Zloty polonais
RON	Nouveau leu roumain
SEK	Couronne suédoise
SGD	Dollar de Singapour
THB	Baht thaïlandais
TRY	Lire turque
TWD	Dollar de Taiwan
USD	Dollar américain
UYU	Peso uruguayen
ZAR	Rand sud-africain

Voir les notes aux états financiers

	Asia Ex-Japan Fund \$	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund \$	Diversified Income Fund \$	Emerging Markets Debt Fund \$	Emerging Markets Debt Local Currency Fund \$	Emerging Markets Equity Fund \$
BILANS								
Actif :								
Placements, à leur valeur	33 810 181	8 051 937	76 693 504	637 887 822	70 744 322	2 089 345 900	25 231 784	77 776 921
Accords de mise en pension (Note 12)	702 449	—	—	55 456 704	1 972 840	169 666 783	2 661 999	1 280 771
Numéraire et autres liquidités	203 953	10 301	194 300	521	10 063	1 761 079	43 364	13
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	—	—	—	—	—	99 000	—	—
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	—	—	—	—	79 350	5 663 750	289 645	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	—	—	14 550	1 693 492	61 717	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	—	9 280	2 836	2 659	45	50 722	—	—
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	—	—	18 983	1 667 132	23 854	—
Créances pour actions de fonds vendues	4 341	88	14 080	3 147 123	460	1 636 472	922	303
Créances pour placements vendus	777 106	—	1 806 547	—	1 105 186	20 986 253	111 702	43 066
Intérêts et dividendes à recevoir	14 470	21 629	124 088	287 233	610 013	26 899 436	458 451	172 363
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	22 078	—
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	8 824	21 092	13 713	58 788	21 439	7 800	22 301	17 101
Créances à recevoir des courtiers	—	—	—	—	—	—	26 539	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	2 385	—
Autres actifs	347	112	481	2 633	523	10 405	265	580
Actif total	35 521 671	8 114 439	78 849 549	696 843 483	74 577 774	2 319 488 224	28 957 006	79 291 118
Passif :								
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	—	—	—	—	—	—	—	4 838
Distributions à payer	—	—	—	—	48 823	2 486 069	14 386	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	—	—	5 736	713 263	142 124	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	—	61	—	68 082	16 804	3 917 511	1 088	4 316
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	—	—	—	—	—	—
Engagements pour placements achetés	—	—	1 503 366	2 080 816	1 039 366	43 185 429	108 937	79 966
Engagements pour actions de fonds rachetées	1 102 637	—	16 409	1 559 872	559 204	5 435 006	7 028	315 151
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	74 785	—	—	—	—	—	1 772	169 608
Intérêts payables sur contrats de swap	—	—	—	—	—	7 540	26 808	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	43 081	—	—
Options vendues, à leur valeur	—	—	—	—	—	—	—	—
Engagements envers les parties liées (Note 5)	—	—	—	—	—	—	—	—
Accrued expenses and other liabilities	164 099	122 997	99 391	225 596	182 936	726 326	138 816	179 715
Passif total	1 341 521	123 058	1 619 166	3 934 366	1 852 869	56 514 225	440 959	753 594
Actif net total	34 180 150	7 991 381	77 230 383	692 909 117	72 724 905	2 262 973 999	28 516 047	78 537 524

Voir les notes aux états financiers

	Emerging Markets Equity Research Fund \$	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund \$	Global Credit Fund \$
BILANS								
Actif :								
Placements, à leur valeur	2 749 839	164 251 167	130 989 350	1 124 942 640	183 334 683	3 053 276 399	566 349 293	91 975 664
Accords de mise en pension (Note 12)	121 605	—	—	—	—	—	—	2 927 490
Numéraire et autres liquidités	2	617 332	315 459	2 661 444	484 878	12 913 652	—	—
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	—	790 100	—	—	—	—	—	394 443
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	1 937	—	—	—	—	—	75 736
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	—	—	37 001	641 979	118 556	1 978 345	53	1
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	—	—	—	—	—	—
Créances pour actions de fonds vendues	—	1 423 279	316 095	8 959 034	656 692	1 853 808	529 451	488 591
Créances pour placements vendus	—	1 010 102	—	3 370 301	—	—	6 588 073	540 741
Intérêts et dividendes à recevoir	5 241	2 459 996	396 304	5 823 722	1 203 401	10 205 898	720 332	1 199 126
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	2 687	—	—	—	—	—	2 745
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	18 349	14 321	—	—	—	—	—	21 048
Créances à recevoir des courtiers	—	34 626	—	—	—	—	—	21 501
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	67 966	—	—	—	—	—	68 554
Autres actifs	75	732	793	7 093	1 110	15 885	3 127	617
Actif total	2 895 111	170 674 245	132 055 002	1 146 406 213	185 799 320	3 080 243 987	574 190 329	97 716 257
Passif :								
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	—	—	—	—	—	—	874 557	797
Distributions à payer	—	—	—	—	—	—	—	4 306
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	173 598	—	—	—	—	—	73 795
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	1 290	—	46	4 782	516	3 040	11 726	3 659
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	172 274	—	—	—	—	—	30 175
Engagements pour placements achetés	—	735 504	—	—	—	—	—	824 352
Engagements pour actions de fonds rachetées	—	466 128	943 115	4 723 714	950 150	26 923 413	721 045	107 046
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	5 111	—	—	—	—	—	—	—
Intérêts payables sur contrats de swap	—	22 452	—	—	—	—	—	12 953
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	—
Options vendues, à leur valeur	—	—	—	—	—	—	—	—
Engagements envers les parties liées (Note 5)	—	—	10 891	64 301	21 582	234 576	41 045	—
Accrued expenses and other liabilities	97 289	112 311	126 336	579 882	191 952	838 389	263 522	121 603
Passif total	103 690	1 682 267	1 080 388	5 372 679	1 164 200	27 999 418	1 911 895	1 178 686
Actif net total	2 791 421	168 991 978	130 974 614	1 141 033 534	184 635 120	3 052 244 569	572 278 434	96 537 571

Voir les notes aux états financiers

	Global Equity Fund \$	Global Equity Income Fund \$	Global High Yield Fund \$	Global Intrinsic Value Fund \$	Global Listed Infrastructure Fund (c) \$	Global New Discovery Fund \$	Global Opportunistic Bond Fund \$	Global Research Focused Fund \$
BILANS								
Actif :								
Placements, à leur valeur	3 114 376 137	6 718 355	225 172 603	70 017 903	2 250 147	5 696 642	423 413 453	128 754 745
Accords de mise en pension (Note 12)	11 119 871	206 516	8 924 023	1 193 497	81 157	343 509	13 711 012	1 594 658
Numéraire et autres liquidités	1 729 221	—	20 650	13	1 264	13	251 912	15
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	—	—	—	—	—	—	260 000	—
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	—	—	9 399	—	—	—	2 765 783	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	390 062	—	—	—	2 027 685	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	5 961	4	606	—	—	—	1 754	7 334
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	—	—	—	—	131 402	—
Créances pour actions de fonds vendues	1 714 496	—	112 055	21 058	—	—	3 525 865	1 706
Créances pour placements vendus	15 775 624	—	1 599 264	1 531 485	—	—	18 110 506	—
Intérêts et dividendes à recevoir	5 265 235	10 708	3 218 994	101 724	1 096	6 088	3 900 943	79 547
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	3 595	—
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	—	23 283	23 945	26 107	25 131	15 992	62 284	16 588
Créances à recevoir des courtiers	—	—	—	—	—	—	246 190	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	89 773	—
Autres actifs	14 798	83	1 298	580	59	100	2 227	802
Actif total	3 150 001 343	6 958 949	239 472 899	72 892 367	2 358 854	6 062 344	468 504 384	130 455 395
Passif :								
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	—	—	—	—	—	—	112 103	—
Distributions à payer	—	—	230 043	—	—	—	67 420	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	25 292	—	—	—	961 745	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	2 013 770	2 823	25 401	49 440	1 190	1 488	301 715	357
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	2 753	—	—	—	—	—
Engagements pour placements achetés	26 859 132	—	3 106 883	841 621	—	20 458	23 197 975	—
Engagements pour actions de fonds rachetées	5 996 257	—	776 873	580 273	—	—	664 825	287 820
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	—	—	—	—	—	—	—	—
Intérêts payables sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	61 384	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	—
Options vendues, à leur valeur	—	—	—	—	—	—	—	—
Engagements envers les parties liées (Note 5)	211 800	—	—	—	—	—	—	—
Accrued expenses and other liabilities	640 833	108 484	236 105	145 605	65 563	100 225	373 202	121 689
Passif total	35 721 792	111 307	4 403 350	1 616 939	66 753	122 171	25 740 369	409 866
Actif net total	3 114 279 551	6 847 642	235 069 549	71 275 428	2 292 101	5 940 173	442 764 015	130 045 529

(c) Le compartiment a commencé ses activités le 13 septembre 2023.

	Global Strategic Equity Fund \$	Global Total Return Fund \$	Inflation- Adjusted Bond Fund \$	Japan Equity Fund ¥	Limited Maturity Fund \$	Managed Wealth Fund \$	Prudent Capital Fund \$	Prudent Wealth Fund \$
BILANS								
Actif :								
Placements, à leur valeur	3 339 719	1 473 719 220	129 078 221	471 831 167	1 113 216 243	12 779 965	3 135 512 624	2 727 083 705
Accords de mise en pension (Note 12)	77 440	21 540 189	4 194 815	—	15 298 305	681 714	235 682 436	194 329 143
Numéraire et autres liquidités	5	—	27 245	10 828 225	236	435	2 194	1 802
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	—	250 000	—	—	—	—	—	—
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	—	1 278 292	110 637	—	3 256 177	455 196	—	—
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	964 318	3 236	—	—	—	2 628 455	2 326 155
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	—	1 466	183	—	—	—	79 512	11 763
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	115 738	—	—	154 075	113 585	—	—
Créances pour actions de fonds vendues	813	623 167	44 115	—	4 493 559	—	3 470 752	2 306 551
Créances pour placements vendus	34 599	14 544 330	—	19 094 207	—	64 383	97 064 167	78 687 570
Intérêts et dividendes à recevoir	148	6 638 737	192 369	681 206	10 098 939	14 725	12 920 454	9 927 375
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	8 040	—	—	2 547 131	—	—	—
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	35 145	—	12 807	1 023 352	—	21 416	—	—
Créances à recevoir des courtiers	—	83 511	—	—	825 013	—	—	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	200 765	—	—	—	—	—	—
Autres actifs	76	7 436	963	11 233	5 588	160	15 906	14 436
Actif total	3 487 945	1 519 975 209	133 664 591	503 469 390	1 149 895 266	14 131 579	3 487 376 500	3 014 688 500
Passif :								
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	—	31 372	—	—	—	—	—	—
Distributions à payer	—	11 629	—	—	78 586	—	534 398	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	1 342 244	—	—	—	—	14 522	—
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	1 772	180 391	61 310	—	307	2 154	2 265 621	2 752 496
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	2 739	—	—	—	—	—
Engagements pour placements achetés	17 490	16 034 589	1 270 898	13 241 319	15 248 025	68 087	109 296 517	92 107 343
Engagements pour actions de fonds rachetées	49 457	6 371 763	1 176 183	32 171	4 149 588	—	8 615 953	7 650 107
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	—	—	—	—	—	86	—	—
Intérêts payables sur contrats de swap	—	—	—	—	2 869 413	—	—	—
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	—
Options vendues, à leur valeur	—	—	—	—	—	—	1 294 267	1 489 738
Engagements envers les parties liées (Note 5)	—	139 620	—	—	33 930	—	298 856	294 550
Accrued expenses and other liabilities	64 241	625 861	141 044	8 537 067	339 910	95 906	897 463	726 175
Passif total	132 960	24 737 469	2 652 174	21 810 557	22 719 759	166 233	123 217 597	105 020 409
Actif net total	3 354 985	1 495 237 740	131 012 417	481 658 833	1 127 175 507	13 965 346	3 364 158 903	2 909 668 091

Voir les notes aux états financiers

BILANS	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund \$	U.S. Corporate Bond Fund \$	U.S. Government Bond Fund \$	U.S. Growth Fund \$	U.S. Total Return Bond Fund \$	U.S. Value Fund \$	Total €
Actif :								
Placements, à leur valeur	16 395 004	458 603 407	568 273 243	348 423 660	56 319 428	889 994 192	1 815 729 643	23 551 870 285
Accords de mise en pension (Note 12)	—	1 353 652	13 509 481	980 771	521 803	24 149 025	6 782 312	731 993 910
Numéraire et autres liquidités	239 232	8	35 749	3 063 240	5	217	77	24 165 113
Numéraire soumis à restrictions (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	563 524
Dépôts auprès des courtiers (Note 2)	—	—	478 038	1 657 426	—	1 823 650	—	17 688 205
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	—	—	—	—	—	9 426 758
Créances découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	—	—	123	8 600	—	—	695	2 946 673
Créances découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	12 547	436 338	—	503 328	—	2 939 744
Créances pour actions de fonds vendues	14 077	504 139	2 618 784	1 928 798	216 667	121 896	1 317 816	39 916 640
Créances pour placements vendus	—	—	1 134 374	23 187 305	675 670	13 679 172	4 107 424	284 226 809
Intérêts et dividendes à recevoir	51 020	221 451	6 913 910	1 777 892	5 615	7 575 166	1 715 296	113 713 657
Intérêts à recevoir sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	—	2 393 349
Créances à recevoir des parties liées (Note 5)	2 504	—	33 763	36 405	13 570	44 970	—	583 208
Créances à recevoir des courtiers	—	—	—	—	—	—	—	1 147 566
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	402 450
Autres actifs	176	2 297	2 897	1 944	391	4 214	8 795	122 367
Actif total	16 702 013	460 684 954	593 012 909	381 502 379	57 753 149	937 895 830	1 829 662 058	24 784 100 258
Passif :								
Engagements envers le dépositaire (cash overdraft)	—	—	—	—	—	—	—	947 226
Distributions à payer	—	—	252 403	227 107	—	64 859	—	3 719 837
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts (Note 10)	—	—	—	—	—	—	—	3 207 484
Engagements découlant de contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories (Note 11)	—	5 047	59 834	687 464	1 850	252 439	213 699	11 949 818
Engagements découlant de la marge de variation quotidienne nette sur les contrats à terme standardisés ouverts	—	—	—	—	—	—	—	205 278
Engagements pour placements achetés	—	—	5 780 193	25 351 436	613 591	38 866 595	4 524 859	382 191 166
Engagements pour actions de fonds rachetées	244 515	751 247	1 128 448	1 956 059	56 620	945 104	5 203 117	86 282 358
Engagements au titre de l'impôt sur les plus-values	—	—	—	—	—	—	—	232 592
Intérêts payables sur contrats de swap	—	—	—	—	—	—	—	2 778 164
Swaps, à leur valeur (Note 14)	—	—	—	—	—	—	—	39 864
Options vendues, à leur valeur	—	—	—	—	—	—	—	2 576 112
Engagements envers les parties liées (Note 5)	—	25 861	—	—	—	—	138 151	1 426 763
Accrued expenses and other liabilities	73 222	224 126	261 539	213 659	86 113	288 991	499 365	9 942 821
Passif total	317 737	1 006 281	7 482 417	28 435 725	758 174	40 417 988	10 579 191	505 499 483
Actif net total	16 384 276	459 678 673	585 530 492	353 066 654	56 994 975	897 477 842	1 819 082 867	24 278 600 775

Voir les notes aux états financiers

ÉTATS FINANCIERS
pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	Asia Ex-Japan Fund \$	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund \$	Diversified Income Fund \$	Emerging Markets Debt Fund \$	Emerging Markets Debt Local Currency Fund \$	Emerging Markets Equity Fund \$
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	1 128 184	294 846	1 595 412	11 031 708	962 093	—	—	2 861 717
Intérêts	34 884	—	1 183	1 311 741	3 214 713	161 506 120	2 075 728	69 621
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	2 200	—	—	101 593	8 344	466 881	5 753	3 901
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	—	—	2 368	—	—	—	—	—
Autre	7 094	11	167	804	1 507	192 569	783	9 202
Impôts à la source (Note 8)	(178 355)	(26 243)	(181 499)	(1 076 007)	(223 972)	(31 993)	(27 346)	(420 397)
Total du produit des placements	994 007	268 614	1 417 631	11 369 839	3 962 685	162 133 577	2 054 918	2 524 044
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	432 705	46 877	477 014	3 290 761	660 206	16 934 263	241 885	671 814
Commissions de distribution et de service (Note 5)	308 157	51 993	69 210	704 485	631 593	4 760 438	156 735	211 587
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	20 922	18 720	28 670	158 542	32 664	758 811	20 038	33 660
Commissions de Dépositaire (Note 6)	80 073	72 245	57 132	193 287	84 914	411 204	67 301	144 211
Coûts du service actionnaires	39 417	20 456	21 275	58 546	46 501	322 795	25 663	31 530
Frais d'impression	6 162	25 327	19 255	46 774	26 548	57 042	13 941	19 987
Révision comptable et autres honoraires	132 920	53 698	52 616	61 272	74 918	104 123	67 425	87 981
Taxe d'abonnement (Note 8)	19 658	3 415	12 493	101 612	38 636	574 470	12 542	18 373
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	—	35	—	12	989	58 891	1 996	241
Commissions de prêt de titres (Note 4)	—	—	356	—	—	—	—	—
Divers	32 693	26 988	26 189	38 797	58 521	254 436	32 757	35 552
Charges totales	1 072 707	319 754	764 210	4 654 088	1 655 490	24 236 473	640 283	1 254 936
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(260 820)	(202 105)	(178 992)	(396 654)	(174 780)	(769 913)	(213 510)	(320 447)
Charges nettes	811 887	117 649	585 218	4 257 434	1 480 710	23 466 560	426 773	934 489
Produit (perte) net(te) des placements	182 120	150 965	832 413	7 112 405	2 481 975	138 667 017	1 628 145	1 589 555
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	(3 133 176)	307 569	933 669	31 240 487	(3 495 468)	(206 557 462)	(1 209 972)	419 451
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	(3 720 342)	155 342	4 446 083	20 493 828	2 520 516	158 243 540	995 194	(4 800 759)
Résultat d'exploitation	(6 671 398)	613 876	6 212 165	58 846 720	1 507 023	90 353 095	1 413 367	(2 791 753)
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	—	—	—	—	(676 190)	(26 550 570)	(461 639)	(239 530)
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	(9 915 305)	(881 880)	51 859 833	372 197 366	(16 352 479)	(62 935 668)	698 102	(1 231 254)
Variation totale de l'actif net	(16 586 703)	(268 004)	58 071 998	431 044 086	(15 521 646)	866 857	1 649 830	(4 262 537)
Actif net								
À l'ouverture de l'exercice	50 766 853	8 259 385	19 158 385	261 865 031	88 246 551	2 262 107 142	26 866 217	82 800 061
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
À la clôture de l'exercice	34 180 150	7 991 381	77 230 383	692 909 117	72 724 905	2 262 973 999	28 516 047	78 537 524

Voir les notes aux états financiers

ÉTATS FINANCIERS

pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	Emerging Markets Equity Research Fund \$	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund \$	Global Credit Fund \$
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	94 805	70 904	3 091 161	61 604 948	6 623 453	89 209 057	11 951 616	—
Intérêts	3 697	4 189 306	1 242	29 587	1 362	55 296	217 624	4 255 428
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	1 967	—	—	—	—	—	10 450	9 408
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	—	—	5 683	231 264	6 198	503 490	47 383	—
Autre	329	414	60	2 986	90	12 738	799	4 405
Impôts à la source (Note 8)	(10 598)	—	(287 204)	(5 476 623)	(306 421)	(11 059 564)	(1 950 813)	(7 696)
Total du produit des placements	90 200	4 260 624	2 810 942	56 392 162	6 324 682	78 721 017	10 277 059	4 261 545
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	26 027	379 603	1 127 190	14 108 722	2 204 159	34 283 006	6 306 286	396 970
Commissions de distribution et de service (Note 5)	2 731	17 237	404 791	2 652 040	1 185 863	13 739 658	1 849 032	117 380
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	20 038	39 785	49 403	604 556	79 906	1 198 228	210 850	35 557
Commissions de Dépositaire (Note 6)	45 597	69 096	66 846	381 538	84 584	535 128	196 440	66 929
Coûts du service actionnaires	13 666	17 410	32 154	215 102	61 356	206 773	81 618	25 117
Frais d'impression	9 984	34 184	18 808	34 346	18 697	26 155	21 190	39 006
Révision comptable et autres honoraires	68 589	55 579	57 349	70 604	59 916	68 933	67 114	60 926
Taxe d'abonnement (Note 8)	466	14 207	42 237	365 626	80 833	1 169 940	162 447	15 801
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	—	3 057	—	41 711	8 655	—	2 326	2 019
Commissions de prêt de titres (Note 4)	—	—	853	34 661	930	75 553	7 107	—
Divers	24 620	26 871	33 022	142 661	44 692	251 711	48 381	35 539
Charges totales	211 718	657 029	1 832 653	18 651 567	3 829 591	51 555 085	8 952 791	795 244
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(181 332)	(155 070)	(46 685)	(465 571)	(82 036)	(15 268)	(27 695)	(220 382)
Charges nettes	30 386	501 959	1 785 968	18 185 996	3 747 555	51 539 817	8 925 096	574 862
Produit (perte) net(te) des placements	59 814	3 758 665	1 024 974	38 206 166	2 577 127	27 181 200	1 351 963	3 686 683
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	(172 872)	(2 067 870)	1 759 196	119 628 467	14 108 857	375 415 517	71 270 197	(6 601 240)
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	(22 447)	7 758 781	4 597 531	(86 381 084)	(7 691 092)	(305 787 309)	(39 319 849)	8 469 610
Résultat d'exploitation	(135 505)	9 449 576	7 381 701	71 453 549	8 994 892	96 809 408	33 302 311	5 555 053
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	—	(4 098)	—	(59 377)	—	—	—	(55 639)
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	50 000	82 374 199	(5 113 033)	(1 171 161 309)	(135 540 202)	(1 008 120 123)	(128 513 576)	11 322 262
Variation totale de l'actif net	(85 505)	91 819 677	2 268 668	(1 099 767 137)	(126 545 310)	(911 310 715)	(95 211 265)	16 821 676
Actif net								
À l'ouverture de l'exercice	2 876 926	77 172 301	128 705 946	2 240 800 671	311 180 430	3 963 555 284	667 489 699	79 715 895
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
À la clôture de l'exercice	2 791 421	168 991 978	130 974 614	1 141 033 534	184 635 120	3 052 244 569	572 278 434	96 537 571

Voir les notes aux états financiers

ÉTATS FINANCIERS

pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	Global Equity Fund \$	Global Equity Income Fund \$	Global High Yield Fund \$	Global Intrinsic Value Fund \$	Global Listed Infrastructure Fund (c) \$	Global New Discovery Fund \$	Global Opportunistic Bond Fund \$	Global Research Focused Fund \$
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	62 872 032	222 217	12 985	1 766 865	23 514	100 852	—	2 319 003
Intérêts	1 174 892	6 033	15 040 315	86 326	25	11 978	18 765 620	61 991
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	64 295	1 197	22 579	5 080	1 018	770	48 387	3 608
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	228 641	—	—	—	—	—	—	3 549
Autre	2 670	474	13 467	225	—	6	5 847	228
Impôts à la source (Note 8)	(10 658 705)	(36 574)	—	(241 283)	(4 900)	(13 264)	(51 679)	(377 215)
Total du produit des placements	53 683 825	193 347	15 089 346	1 617 213	19 657	100 342	18 768 175	2 011 164
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	29 889 031	33 398	1 684 904	831 873	6 270	53 735	2 082 521	1 237 911
Commissions de distribution et de service (Note 5)	9 811 549	24 050	1 692 271	558 965	971	30 530	1 447 108	755 190
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	1 078 512	20 038	83 588	36 470	7 730	20 038	144 232	50 744
Commissions de Dépositaire (Note 6)	448 675	56 455	102 514	79 172	16 294	44 714	210 766	61 984
Coûts du service actionnaires	251 039	21 693	115 356	48 519	5 984	18 354	102 704	36 375
Frais d'impression	28 993	22 425	35 015	21 806	12 304	18 150	96 193	29 433
Révision comptable et autres honoraires	79 382	66 808	74 887	64 599	36 765	59 100	80 453	63 956
Taxe d'abonnement (Note 8)	849 694	2 547	110 419	34 367	226	2 146	155 957	51 833
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	3 562	—	601	53	13	—	4 026	16
Commissions de prêt de titres (Note 4)	34 296	—	—	—	—	—	—	533
Divers	187 264	26 391	53 152	35 705	7 129	25 866	82 847	33 261
Charges totales	42 661 997	273 805	3 952 707	1 711 529	93 686	272 633	4 406 807	2 321 236
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(74 822)	(204 878)	(247 913)	(242 138)	(85 921)	(183 562)	(400 699)	(223 697)
Charges nettes	42 587 175	68 927	3 704 794	1 469 391	7 765	89 071	4 006 108	2 097 539
Produit (perte) net(te) des placements	11 096 650	124 420	11 384 552	147 822	11 892	11 271	14 762 067	(86 375)
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	297 788 995	(7 392)	(10 178 629)	2 785 294	4 210	(409 706)	(21 613 316)	6 846 693
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	(117 923 755)	(8 834)	17 710 771	6 044 895	78 943	748 694	22 133 709	5 712 300
Résultat d'exploitation	190 961 890	108 194	18 916 694	8 978 011	95 045	350 259	15 282 460	12 472 618
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	—	(15 579)	(4 281 768)	—	—	—	(877 369)	—
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	(514 103 682)	1 814 319	(17 212 348)	(33 235 334)	2 197 056	(485 421)	79 636 800	(19 992 130)
Variation totale de l'actif net	(323 141 792)	1 906 934	(2 577 422)	(24 257 323)	2 292 101	(135 162)	94 041 891	(7 519 512)
Actif net								
À l'ouverture de l'exercice	3 437 421 343	4 940 708	237 646 971	95 532 751	—	6 075 335	348 722 124	137 565 041
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
À la clôture de l'exercice	3 114 279 551	6 847 642	235 069 549	71 275 428	2 292 101	5 940 173	442 764 015	130 045 529

(c) Le compartiment a commencé ses activités le 13 septembre 2023.

Voir les notes aux états financiers

ÉTATS FINANCIERS

pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	Global Strategic Equity Fund \$	Global Total Return Fund \$	Inflation- Adjusted Bond Fund \$	Japan Equity Fund ¥	Limited Maturity Fund \$	Managed Wealth Fund \$	Prudent Capital Fund \$	Prudent Wealth Fund \$
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	26 833	31 406 031	—	10 220 857	—	301 245	38 550 647	43 691 949
Intérêts	826	26 229 193	8 217 964	—	43 540 681	88 506	69 541 582	40 854 536
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	2 729	90 820	6 278	—	88 017	7 661	549 282	489 525
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	—	72 199	—	—	—	—	—	118 911
Autre	24	657	58	61 904	9 876	6	2 330	1 414
Impôts à la source (Note 8)	(5 078)	(5 097 913)	—	(1 564 887)	—	(60 545)	(4 696 699)	(5 111 065)
Total du produit des placements	25 334	52 700 987	8 224 300	8 717 874	43 638 574	336 873	103 947 142	80 045 270
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	20 806	15 997 910	832 980	4 019 282	5 480 878	152 762	34 264 130	35 359 847
Commissions de distribution et de service (Note 5)	4 196	11 128 404	803 408	1 769 992	4 166 781	67 240	21 572 373	21 030 047
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	20 038	536 660	62 797	2 659 022	338 417	20 038	1 178 707	1 069 650
Commissions de Dépositaire (Note 6)	19 290	413 755	63 571	3 945 775	232 809	50 134	503 857	485 234
Coûts du service actionnaires	17 250	279 244	74 736	2 229 153	168 925	18 402	524 507	264 514
Frais d'impression	38 384	35 057	14 195	1 356 611	16 622	36 496	69 640	39 151
Révision comptable et autres honoraires	41 667	89 270	60 685	7 317 314	62 876	57 866	70 736	67 042
Taxe d'abonnement (Note 8)	567	701 445	68 968	170 311	427 658	5 274	1 426 151	1 336 199
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	—	22 065	4 164	25 118	67 437	7 525	1 521	401
Commissions de prêt de titres (Note 4)	—	10 830	—	—	—	—	—	17 837
Divers	23 248	113 272	39 655	3 236 062	60 725	26 344	231 450	239 601
Charges totales	185 446	29 327 912	2 025 159	26 728 640	11 023 128	442 081	59 843 072	59 909 523
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(158 728)	(49 600)	(256 683)	(20 523 725)	(140 102)	(193 013)	(13 023)	(472)
Charges nettes	26 718	29 278 312	1 768 476	6 204 915	10 883 026	249 068	59 830 049	59 909 051
Produit (perte) net(te) des placements	(1 384)	23 422 675	6 455 824	2 512 959	32 755 548	87 805	44 117 093	20 136 219
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	40 728	8 442 382	(23 674 464)	22 261 206	(15 754 484)	(1 413 004)	(138 794 319)	(50 780 828)
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	594 347	5 341 483	15 899 153	79 633 989	27 036 270	2 134 319	375 162 230	273 844 034
Résultat d'exploitation	633 691	37 206 540	(1 319 487)	104 408 154	44 037 334	809 120	280 485 004	243 199 425
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	—	(2 156 154)	(532 078)	—	(1 588 415)	—	(534 398)	—
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	299 231	(233 730 984)	(75 306 517)	2 849 341	225 801 962	(6 107 468)	(748 120 849)	(906 001 865)
Variation totale de l'actif net	932 922	(198 680 598)	(77 158 082)	107 257 495	268 250 881	(5 298 348)	(468 170 243)	(662 802 440)
Actif net								
À l'ouverture de l'exercice	2 422 063	1 693 918 338	208 170 499	374 401 338	858 924 626	19 263 694	3 832 329 146	3 572 470 531
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
À la clôture de l'exercice	3 354 985	1 495 237 740	131 012 417	481 658 833	1 127 175 507	13 965 346	3 364 158 903	2 909 668 091

Voir les notes aux états financiers

ÉTATS FINANCIERS

pour l'exercice clos le 31 janvier 2024

COMPTES DE PROFITS ET PERTES ET TABLEAUX DE VARIATION DE L'ACTIF NET	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund \$	U.S. Corporate Bond Fund \$	U.S. Government Bond Fund \$	U.S. Growth Fund \$	U.S. Total Return Bond Fund \$	U.S. Value Fund \$	Total €
Produit (perte) net(te) des placements								
Revenus								
Dividendes	783 487	4 663 172	—	—	284 227	—	46 610 733	404 874 102
Intérêts	1 646	172 421	25 030 453	14 252 085	46 560	35 603 332	828 956	441 259 401
Revenu sur accords de mise en pension (Note 2)	—	9 924	45 571	56 710	913	61 156	47 536	2 048 258
Revenus sur titres prêtés (Note 4)	75	—	—	—	—	—	81 835	1 260 350
Autre	6	112	35 291	610	544	1 192	19 682	305 754
Impôts à la source (Note 8)	(10 654)	(1 076 436)	(63 378)	(42 371)	(71 296)	(181 889)	(12 647 060)	(58 411 536)
Total du produit des placements	774 560	3 769 193	25 047 937	14 267 034	260 948	35 483 791	34 941 682	791 336 329
Charges								
Commission de gestion financière (Note 5)	166 337	5 088 662	2 731 277	1 767 156	292 258	3 572 371	17 885 873	227 018 670
Commissions de distribution et de service (Note 5)	109 668	3 238 490	2 279 294	1 141 611	203 137	1 431 622	9 659 248	110 597 531
Commission de la Société de Gestion (Note 5)	16 579	157 962	175 353	128 412	23 035	259 939	646 921	8 856 909
Commissions de Dépositaire (Note 6)	11 992	128 489	153 740	132 904	36 115	210 598	262 929	5 935 729
Coûts du service actionnaires	20 697	132 820	120 515	96 111	25 548	84 141	333 770	3 745 373
Frais d'impression	10 455	11 840	15 794	15 246	14 258	24 515	19 521	989 337
Révision comptable et autres honoraires	48 401	61 352	63 003	63 899	59 920	65 397	71 563	2 452 145
Taxe d'abonnement (Note 8)	6 790	204 081	221 554	145 938	14 078	180 538	783 657	8 792 538
Intérêts et charges assimilées (Note 2)	—	45	8 386	24 633	—	13 836	213	261 787
Commissions de prêt de titres (Note 4)	11	—	—	—	—	—	12 275	189 055
Divers	20 605	43 960	49 895	77 378	26 689	72 277	105 361	2 560 893
Charges totales	411 535	9 067 701	5 818 811	3 593 288	695 038	5 915 234	29 781 331	371 399 967
Charges remboursées par les parties liées (Note 5)	(119 743)	(206 388)	(205 069)	(396 527)	(164 756)	(908 175)	(96 210)	(7 909 033)
Charges nettes	291 792	8 861 313	5 613 742	3 196 761	530 282	5 007 059	29 685 121	363 490 934
Produit (perte) net(te) des placements	482 768	(5 092 120)	19 434 195	11 070 273	(269 334)	30 476 732	5 256 561	427 845 395
Plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change								
Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change	(652 935)	24 954 454	(31 564 524)	(13 598 974)	628 021	(12 585 204)	197 378 254	602 227 442
Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises	(554 357)	38 684 539	33 613 859	1 240 893	12 977 163	11 374 510	(145 102 405)	292 581 547
Résultat d'exploitation	(724 524)	58 546 873	21 483 530	(1 287 808)	13 335 850	29 266 038	57 532 410	1 322 654 384
Distributions déclarées aux actionnaires (Note 2)	(11 169)	—	(3 717 725)	(2 595 082)	—	(1 315 219)	—	(42 268 991)
Variation de l'actif net résultant des opérations sur les actions de fonds	(4 733 834)	(55 170 025)	167 787 306	10 288 379	(2 370 271)	426 296 161	(445 124 747)	(4 021 967 384)
Variation totale de l'actif net	(5 469 527)	3 376 848	185 553 111	6 405 489	10 965 579	454 246 980	(387 592 337)	(2 741 581 991)
Actif net								
À la clôture de l'exercice	21 853 803	456 301 825	399 977 381	346 661 165	46 029 396	443 230 862	2 206 675 204	26 899 525 297
Conversion de devises à l'ouverture de l'exercice (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	120 657 469
À la clôture de l'exercice	16 384 276	459 678 673	585 530 492	353 066 654	56 994 975	897 477 842	1 819 082 867	24 278 600 775

Voir les notes aux états financiers

	Asia Ex-Japan Fund \$	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund \$	Diversified Income Fund \$	Emerging Markets Debt Fund \$
STATISTIQUES						
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2022	58 216 830	8 442 883	40 295 957	135 759 012	116 659 896	2 732 792 256
31 janvier 2023	50 766 853	8 259 385	19 158 385	261 865 031	88 246 551	2 262 107 142
31 janvier 2024	34 180 150	7 991 381	77 230 383	692 909 117	72 724 905	2 262 973 999
Actions en circulation au 31 janvier 2024						
Catégorie A1 (EUR)	54 396	92 298	106 280	3 703 013	—	770 199
Catégorie A1 (USD)	829 584	52 779	108 909	3 652 143	1 687 046	9 667 754
Catégorie AH1 (EUR)	—	—	—	291 359	224 392	2 195 017
Catégorie AH1 (USD)	—	56 831	—	—	—	—
Catégorie A2 (USD)	—	—	—	—	1 086 377	10 543 907
Catégorie A4 (EUR)	—	—	—	—	20 002	—
Catégorie C1 (USD)	124 917	24 856	13 301	1 111 060	1 293 861	2 027 029
Catégorie C2 (USD)	—	—	—	—	307 333	2 083 368
Catégorie I1 (EUR)	—	408	511	2 031 795	—	—
Catégorie I1 (GBP)	181	217	92 446	414	—	526
Catégorie I1 (USD)	1 580	79 128	317 353	232 615	1 191	2 651 613
Catégorie IF1 (EUR)	—	145	359	—	—	—
Catégorie IF1 (GBP)	—	—	14 258	—	—	—
Catégorie IH1 (CHF)	—	—	—	—	—	71 074
Catégorie IH1 (EUR)	—	—	—	791	522	3 441 433
Catégorie IH1 (USD)	—	500	—	—	—	—
Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	—	1 234 482
Catégorie I2 (GBP)	—	—	—	—	—	733 523
Catégorie IS1 (EUR)	—	—	—	262	—	—
Catégorie IS1 (USD)	—	—	—	—	—	226
Catégorie ISH1 (EUR)	—	—	—	—	—	2 717
Catégorie ISH2 (EUR)	—	—	—	—	—	567
Catégorie ISH2 (GBP)	—	—	—	—	—	621
Catégorie ISM1 (USD)	—	—	—	—	—	7 713
Catégorie N1 (USD)	135 577	15 552	5 041	1 464 202	1 031 913	3 573 812
Catégorie NH1 (USD)	—	14 912	—	—	—	—
Catégorie N2 (USD)	—	—	—	—	142 883	697 091
Catégorie P1 (EUR)	—	2 236	—	29 410	14 914	162 571
Catégorie P1 (USD)	—	—	—	—	4 382	1 856
Catégorie PH1 (EUR)	—	—	—	—	5 222	12 037
Catégorie S1 (USD)	54 533	—	—	—	—	143 866
Catégorie W1 (EUR)	—	5 821	139 275	96 436	30 725	12 584
Catégorie W1 (GBP)	—	—	—	234 601	—	—
Catégorie W1 (USD)	143 358	5 000	4 967	890 947	133 457	3 550 847
Catégorie WH1 (EUR)	—	—	—	102 099	9 461	763 057
Catégorie WH1 (GBP)	—	2 988	94 148	51 982	4 346	362 447
Catégorie WH1 (USD)	—	5 000	—	—	—	—
Catégorie W2 (USD)	—	—	—	—	167 855	7 410 406
Catégorie WS1 (USD)	—	—	—	1 113 579	—	145 253
Catégorie WSH1 (CHF)	—	—	—	185 347	—	—

	Asia Ex-Japan Fund \$	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund \$	Diversified Income Fund \$	Emerging Markets Debt Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Catégorie WSH1 (EUR)	—	—	—	234 298	—	4 101
Catégorie WSH2 (GBP)	—	—	—	—	—	7 779
Catégorie Z1 (USD)	—	—	—	—	—	76 728
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2022	30,23	27,46	29,88	—	—	25,02
31 janvier 2023	27,66	27,36	29,84	14,39	—	23,25
31 janvier 2024	23,77	29,37	32,17	16,14	—	24,43
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	17,26	—	—	11,46
31 janvier 2023	—	—	18,20	—	—	11,24
31 janvier 2024	—	—	—(a)	—	—	—(a)
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2022	37,70	21,40	28,60	15,25	13,48	41,62
31 janvier 2023	33,38	20,63	27,64	15,81	12,49	37,42
31 janvier 2024	28,53	22,02	29,62	17,63	12,87	39,10
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	14,46	11,95	13,46
31 janvier 2023	—	—	—	14,40	10,75	11,78
31 janvier 2024	—	—	—	15,68	10,85	12,05
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	18,92	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	19,40	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	21,24	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,35	16,63
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,21	14,29
31 janvier 2024	—	—	—	—	10,16	14,10
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,04	8,76
31 janvier 2023	—	—	—	—	8,80	7,31
31 janvier 2024	—	—	—	—	—(a)	—(a)
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A4 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,78	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,03	—
31 janvier 2024	—	—	—	—	10,02	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH4 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,30	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,02	—
31 janvier 2024	—	—	—	—	—(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2022	31,71	16,73	16,34	14,96	12,53	34,04
31 janvier 2023	27,86	16,01	15,67	15,40	11,50	30,30
31 janvier 2024	23,63	16,96	16,67	17,04	11,72	31,35

	Asia Ex-Japan Fund \$	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund \$	Diversified Income Fund \$	Emerging Markets Debt Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie CH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	18,24	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	18,64	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	—(a)	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,32	16,62
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,19	14,28
31 janvier 2024	—	—	—	—	10,14	14,09
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	305,48	120,52	154,65	—	—
31 janvier 2023	—	307,46	121,72	167,55	—	—
31 janvier 2024	—	333,36	132,69	190,01	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2022	409,85	291,90	409,35	141,88	—	247,92
31 janvier 2023	400,15	310,14	436,30	162,26	—	245,01
31 janvier 2024	336,36	325,19	459,95	177,95	—	251,00
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2022	345,34	17,14	19,53	156,67	142,18	262,96
31 janvier 2023	309,07	16,69	19,08	164,24	132,88	238,22
31 janvier 2024	267,05	17,99	20,67	185,15	138,01	250,88
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IF1 (EUR)						
31 janvier 2024	—	333,77(a)	132,94(a)	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IF1 (GBP)						
31 janvier 2024	—	—	460,84(a)	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (CHF)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	111,98
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	98,20
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	99,45
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	148,88	117,58	143,81
31 janvier 2023	—	—	—	149,81	107,04	126,85
31 janvier 2024	—	—	—	164,62	109,17	130,95
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	200,46	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	208,02	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	229,58	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	124,94
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	104,58
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	101,22
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I2 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	104,80
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	98,29
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	94,47

	Asia Ex-Japan Fund \$	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund \$	Diversified Income Fund \$	Emerging Markets Debt Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	266,67
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	241,96
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	255,17
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS1 (EUR)						
31 janvier 2024	—	—	—	190,05(a)	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	145,99
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	129,19
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	133,56
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISH2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	137,18
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	114,70
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	110,95
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISH2 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	107,94
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	91,36
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	89,76
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISM1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	265,79
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	241,40
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	254,88
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2022	14,68	16,98	16,65	15,06	13,00	11,81
31 janvier 2023	12,93	16,29	16,01	15,54	11,98	10,57
31 janvier 2024	10,99	17,30	17,07	17,24	12,28	10,99
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie NH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	18,49	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	18,94	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	20,54	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,32	8,73
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,19	7,50
31 janvier 2024	—	—	—	—	10,12	7,40
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	27,45	—	—	12,68	25,02
31 janvier 2023	—	27,36	—	—	12,14	23,24
31 janvier 2024	—	29,36	—	16,14(a)	12,58	24,43
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	13,48	41,62
31 janvier 2023	—	—	—	—	12,49	37,43
31 janvier 2024	—	—	—	—	12,86	39,11

	Asia Ex-Japan Fund \$	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund \$	Diversified Income Fund \$	Emerging Markets Debt Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,98	13,43
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,80	11,76
31 janvier 2024	—	—	—	—	10,90	12,05
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2022	46,14	—	—	—	—	37,20
31 janvier 2023	41,25	—	—	—	—	33,62
31 janvier 2024	35,61	—	—	—	—	35,32
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	20,13	22,94	—	13,84	12,67
31 janvier 2023	—	20,24	23,13	14,92	13,36	11,84
31 janvier 2024	—	21,93	25,19	16,91	13,94	12,66
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	—	14,15	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	16,17	—	—
31 janvier 2024	—	—	—	17,72	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2022	20,14	18,31	19,11	15,63	14,11	18,04
31 janvier 2023	18,01	17,81	18,66	16,37	13,17	16,32
31 janvier 2024	15,54	19,18	20,20	18,44	13,67	17,16
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	14,85	12,66	11,54
31 janvier 2023	—	—	—	14,91	11,50	10,19
31 janvier 2024	—	—	—	16,37	11,71	10,53
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	22,49	25,63	14,92	13,14	15,79
31 janvier 2023	—	22,81	26,16	15,19	12,09	14,09
31 janvier 2024	—	25,07	28,86	16,93	12,49	14,74
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	19,91	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	20,64	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	22,76	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,38	8,94
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,23	7,69
31 janvier 2024	—	—	—	—	10,18	7,59
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	8,90
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	7,42
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	—(a)
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH2 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	8,56
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	7,23
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	—(a)

	Asia Ex-Japan Fund \$	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund \$	Diversified Income Fund \$	Emerging Markets Debt Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WS1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	18,29
31 janvier 2023	—	—	—	16,39	—	16,61
31 janvier 2024	—	—	—	18,49	—	17,54
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WSH1 (CHF)						
31 janvier 2023	—	—	—	11,26	—	—
31 janvier 2024	—	—	—	12,12	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WSH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	11,94
31 janvier 2023	—	—	—	14,93	—	10,56
31 janvier 2024	—	—	—	16,42	—	11,46
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WSH2 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	8,61
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	7,31
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	7,20
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	254,39
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	232,09
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	246,14
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5)						
Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024 :						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	2,00	1,60	1,85	1,85	—	1,53
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,98	1,60	1,85	1,85	1,60	1,53
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	—	—	—	1,85	1,60	1,55
Frais sur encours - Catégorie AH1 (USD)	—	1,60	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	—	—	—	—	1,60	1,52
Frais sur encours - Catégorie A4 (EUR)	—	—	—	—	1,60	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,75	2,35	2,60	2,60	2,60	2,53
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	—	—	—	—	2,60	2,53
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	—	0,60	0,75	0,75	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	0,90	0,60	0,75	0,75	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,90	0,60	0,75	0,75	0,75	0,75
Frais sur encours - Catégorie IF1 (EUR)	—	0,45(e)	0,50(e)	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IF1 (GBP)	—	—	0,50(e)	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (CHF)	—	—	—	—	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	—	—	—	0,75	0,75	0,75
Frais sur encours - Catégorie IH1 (USD)	—	0,60	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie I2 (GBP)	—	—	—	—	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie IS1 (EUR)	—	—	—	0,63(e)	—	—
Frais sur encours - Catégorie IS1 (USD)	—	—	—	—	—	0,60
Frais sur encours - Catégorie ISH1 (EUR)	—	—	—	—	—	0,51
Frais sur encours - Catégorie ISH2 (EUR)	—	—	—	—	—	0,51
Frais sur encours - Catégorie ISH2 (GBP)	—	—	—	—	—	0,51
Frais sur encours - Catégorie ISM1 (USD)	—	—	—	—	—	0,48
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,50	2,10	2,35	2,35	2,10	2,03

	Asia Ex-Japan Fund \$	Blended Research European Equity Fund €	Continental European Equity Fund €	Contrarian Value Fund \$	Diversified Income Fund \$	Emerging Markets Debt Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Frais sur encours - Catégorie NH1 (USD)	—	2,10	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	—	—	—	—	2,10	2,03
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	—	1,60	—	1,85(e)	1,60	1,53
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	—	—	—	1,60	1,53
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	—	—	—	1,60	1,55
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	1,00	—	—	—	—	0,99
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	—	0,70	0,85	0,85	0,85	0,81
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	—	—	—	0,85	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	1,00	0,70	0,85	0,85	0,85	0,90
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	—	—	—	0,85	0,85	0,90
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	—	0,70	0,85	0,85	0,85	0,90
Frais sur encours - Catégorie WH1 (USD)	—	0,70	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	—	—	—	—	0,85	0,90
Frais sur encours - Catégorie WS1 (USD)	—	—	—	0,65	—	0,52
Frais sur encours - Catégorie WSH1 (CHF)	—	—	—	0,65	—	—
Frais sur encours - Catégorie WSH1 (EUR)	—	—	—	0,65	—	0,55
Frais sur encours - Catégorie Z1 (USD)	—	—	—	—	—	0,05
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024	28	68	(12)	62	128	37

(a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.

(e) Annualisés.

	Emerging Markets Debt Local Currency Fund \$	Emerging Markets Equity Fund \$	Emerging Markets Equity Research Fund \$	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
STATISTIQUES						
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2022	35 268 434	96 635 391	3 091 088	86 861 510	172 966 253	2 810 659 767
31 janvier 2023	26 866 217	82 800 061	2 876 926	77 172 301	128 705 946	2 240 800 671
31 janvier 2024	28 516 047	78 537 524	2 791 421	168 991 978	130 974 614	1 141 033 534
Actions en circulation au 31 janvier 2024						
Catégorie A1 (EUR)	94 291	57 373	—	357 189	247 007	3 198 661
Catégorie A1 (USD)	361 386	946 720	7 742	35 247	1 015 221	3 918 220
Catégorie AH1 (EUR)	—	—	4 220	—	—	—
Catégorie AH1 (USD)	—	—	—	—	126 474	1 582 389
Catégorie A2 (USD)	978 103	—	—	7 381	—	—
Catégorie C1 (USD)	323 187	316 052	7 770	14 130	127 717	420 180
Catégorie C2 (USD)	155 060	—	—	7 321	—	—
Catégorie I1 (EUR)	—	156 710	648	927 637	111 779	1 129 042
Catégorie I1 (GBP)	—	449	545	524	251	959
Catégorie I1 (USD)	38 539	12 933	27 085	955	403 825	455 170
Catégorie IF1 (EUR)	—	—	—	510 634	—	—
Catégorie IH1 (EUR)	—	—	791	—	—	—
Catégorie IH1 (SGD)	—	—	—	—	—	723
Catégorie IH1 (USD)	—	—	—	—	—	39 234
Catégorie IH1R (EUR)	—	—	—	—	—	609
Catégorie I2 (EUR)	—	50 397	—	—	—	—
Catégorie IS1 (EUR)	—	—	—	—	—	222 223
Catégorie ISB1 (EUR)	—	—	—	—	—	323 184
Catégorie ISD1 (EUR)	—	—	—	—	—	146
Catégorie N1 (USD)	126 937	308 324	14 070	40 088	67 549	643 931
Catégorie NH1 (USD)	—	—	—	—	33 079	334 800
Catégorie N2 (USD)	51 265	—	—	—	—	—
Catégorie P1 (EUR)	—	3 718	—	4 498	—	22 196
Catégorie P1 (USD)	—	4 772	—	—	—	—
Catégorie PH1 (EUR)	—	4 631	—	—	—	—
Catégorie S1 (USD)	—	43 872	—	—	—	—
Catégorie W1 (EUR)	—	—	—	1 099 876	155 563	1 302 295
Catégorie W1 (GBP)	—	—	—	6 065	153 450	—
Catégorie W1 (USD)	277 433	252 684	7 710	6 765	943 789	3 440 025
Catégorie WH1 (EUR)	7 063	5 494	7 919	—	—	—
Catégorie WH1 (GBP)	10 164	59 570	6 824	—	6 937	113 886
Catégorie WH1 (USD)	—	—	—	—	76 387	3 511 710
Catégorie W2 (USD)	87 065	—	—	—	—	—
Catégorie Z1 (EUR)	—	535	—	—	—	325
Catégorie Z1 (JPY)	—	139 641	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2022	15,96	17,45	—	10,82	50,23	47,48
31 janvier 2023	15,69	15,73	—	9,53	48,62	45,81
31 janvier 2024	16,74	15,16	—	10,24	51,11	48,08

	Emerging Markets Debt Local Currency Fund \$	Emerging Markets Equity Fund \$	Emerging Markets Equity Research Fund \$	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2022	13,23	15,31	9,61	10,76	32,55	31,02
31 janvier 2023	12,58	13,36	8,19	9,17	30,48	28,97
31 janvier 2024	13,34	12,80	7,74	9,81	31,85	30,22
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	9,56	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	7,89	—	—	—
31 janvier 2024	—	—	7,30	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	35,98	19,95
31 janvier 2023	—	—	—	—	35,90	19,88
31 janvier 2024	—	—	—	—	38,39	21,23
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	10,62	—	—
31 janvier 2023	—	—	—	9,23	—	—
31 janvier 2024	—	—	—	—(a)	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2022	7,03	—	—	10,57	—	—
31 janvier 2023	6,39	—	—	8,89	—	—
31 janvier 2024	6,39	—	—	9,20	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2022	11,65	13,63	9,57	10,45	15,90	14,26
31 janvier 2023	10,97	11,80	8,13	8,81	14,78	13,21
31 janvier 2024	11,51	11,22	7,63	9,32	15,33	13,68
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie CH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	19,25	17,08
31 janvier 2023	—	—	—	—	19,05	16,86
31 janvier 2024	—	—	—	—	—(a)	—(a)
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2022	7,02	—	—	10,45	—	—
31 janvier 2023	6,38	—	—	8,78	—	—
31 janvier 2024	6,38	—	—	9,09	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	205,22	101,85	110,41	417,57	318,30
31 janvier 2023	—	186,94	90,60	97,93	408,80	310,46
31 janvier 2024	—	182,04	87,09	105,97	434,72	329,38
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	234,82	99,18	104,61	349,87	363,97
31 janvier 2023	—	225,81	93,13	97,96	361,57	374,76
31 janvier 2024	—	212,64	86,58	102,51	371,83	384,49
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2022	145,47	179,91	96,69	109,85	18,94	266,43
31 janvier 2023	139,39	158,60	83,23	94,30	17,95	251,47
31 janvier 2024	148,79	153,52	79,53	101,43	18,97	265,21

	Emerging Markets Debt Local Currency Fund \$	Emerging Markets Equity Fund \$	Emerging Markets Equity Research Fund \$	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IF1 (EUR)						
31 janvier 2024	—	—	—	106,09(a)	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	96,16	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	80,26	—	—	—
31 janvier 2024	—	—	75,16	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (SGD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	142,40
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	142,42
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	159,20
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	221,10
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	221,96
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	239,72
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1R (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	342,90
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	403,72
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	475,33
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	197,04	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	175,90	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	166,96	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I3 (EUR)						
1 janvier 2022	—	—	—	—	—	293,93
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	249,72
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	—(a)
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	319,97
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	312,55
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	332,10
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISB1 (EUR)						
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	312,93
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	333,27
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISD1 (EUR)						
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	332,28(a)
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2022	8,29	10,80	9,58	10,61	16,19	16,61
31 janvier 2023	7,85	9,37	8,12	9,00	15,09	15,43
31 janvier 2024	8,28	8,93	7,64	9,56	15,69	16,01
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie NH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	19,66	17,50
31 janvier 2023	—	—	—	—	19,48	17,30
31 janvier 2024	—	—	—	—	20,77	18,40

	Emerging Markets Debt Local Currency Fund \$	Emerging Markets Equity Fund \$	Emerging Markets Equity Research Fund \$	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2022	5,58	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	5,07	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	5,07	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	17,45	—	—	—	47,45
31 janvier 2023	—	15,73	—	—	—	45,79
31 janvier 2024	—	15,16	—	10,25(b)	—	48,05
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2022	—	15,32	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	13,36	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	12,80	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	16,42	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	13,88	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	12,99	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2022	—	18,36	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	16,18	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	15,65	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	11,01	22,26	20,39
31 janvier 2023	—	—	—	9,76	21,77	19,87
31 janvier 2024	—	—	—	10,54	23,13	21,06
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	—	10,43	19,24	—
31 janvier 2023	—	—	—	9,76	19,86	—
31 janvier 2024	—	—	—	10,20	20,41	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2022	11,71	13,67	9,66	10,95	18,09	16,15
31 janvier 2023	11,21	12,04	8,31	9,39	17,13	15,23
31 janvier 2024	11,96	11,64	7,93	10,10	18,09	16,05
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2022	11,12	13,87	9,61	—	—	—
31 janvier 2023	10,34	11,81	8,01	—	—	—
31 janvier 2024	10,81	11,17	7,50	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2022	9,93	11,56	9,64	—	27,16	22,59
31 janvier 2023	9,36	9,97	8,15	—	26,88	22,22
31 janvier 2024	9,92	9,58	7,74	—	28,92	23,88
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	18,35	19,45
31 janvier 2023	—	—	—	—	18,50	19,54
31 janvier 2024	—	—	—	—	20,01	21,09

	Emerging Markets Debt Local Currency Fund \$	Emerging Markets Equity Fund \$	Emerging Markets Equity Research Fund \$	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2022	5,80	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	5,26	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	5,25	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	168,70	—	—	—	262,39
31 janvier 2023	—	155,07	—	—	—	257,86
31 janvier 2024	—	152,37	—	—	—	275,64
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (JPY)						
31 janvier 2022	—	11.816	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	11.888	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	13.130	—	—	—	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5)						
Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024 :						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	1,51	2,00	—	1,20	2,05	1,93
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,51	2,00	2,00	1,20	2,05	1,93
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	—	—	2,00	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie AH1 (USD)	—	—	—	—	2,05	1,96
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	1,51	—	—	1,20	—	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,51	2,75	2,75	2,20	2,79	2,68
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	2,51	—	—	2,20	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	—	0,95	0,95	0,50	0,90	0,84
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	—	0,95	0,95	0,50	0,90	0,84
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,80	0,95	0,95	0,50	0,90	0,84
Frais sur encours - Catégorie IF1 (EUR)	—	—	—	0,35(e)	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	—	—	0,95	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (SGD)	—	—	—	—	—	0,85
Frais sur encours - Catégorie IH1 (USD)	—	—	—	—	—	0,87
Frais sur encours - Catégorie IH1R (EUR)	—	—	—	—	—	0,90
Frais sur encours - Catégorie I2 (EUR)	—	0,95	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IS1 (EUR)	—	—	—	—	—	0,69
Frais sur encours - Catégorie ISB1 (EUR)	—	—	—	—	—	0,46
Frais sur encours - Catégorie ISD1 (EUR)	—	—	—	—	—	0,58(e)
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,01	2,50	2,50	1,70	2,55	2,43
Frais sur encours - Catégorie NH1 (USD)	—	—	—	—	2,55	2,46
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	2,01	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	—	2,00	—	—	—	1,93
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	2,00	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	2,00	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	—	1,00	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	—	—	—	0,60	1,00	0,93
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	—	—	—	0,60	1,00	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	0,91	1,05	1,05	0,60	1,00	0,93
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	0,91	1,05	1,05	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	0,91	1,05	1,05	—	1,00	0,97

	Emerging Markets Debt Local Currency Fund \$	Emerging Markets Equity Fund \$	Emerging Markets Equity Research Fund \$	Euro Credit Fund €	European Core Equity Fund €	European Research Fund €
STATISTIQUES — (suite)						
Frais sur encours - Catégorie WH1 (USD)	—	—	—	—	1,00	0,95
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	0,91	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie Z1 (EUR)	—	0,05	—	—	—	0,09
Frais sur encours - Catégorie Z1 (JPY)	—	0,05	—	—	—	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024	67	44	78	188	(13)	(9)

(a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.

(b) Pour de plus amples informations, voir la Note 19.

(e) Annualisés.

	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund \$	Global Credit Fund \$	Global Equity Fund \$	Global Equity Income Fund \$
STATISTIQUES						
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2022	526 429 396	5 054 403 885	760 334 657	95 862 996	4 050 736 005	3 255 094
31 janvier 2023	311 180 430	3 963 555 284	667 489 699	79 715 895	3 437 421 343	4 940 708
31 janvier 2024	184 635 120	3 052 244 569	572 278 434	96 537 571	3 114 279 551	6 847 642
Actions en circulation au 31 janvier 2024						
Catégorie A1 (EUR)	1 330 366	20 139 190	1 551 949	207 600	10 433 590	—
Catégorie A1 (USD)	472 062	4 911 646	1 567 674	654 274	5 792 124	30 724
Catégorie AH1 (CHF)	—	342 518	—	—	—	—
Catégorie AH1 (EUR)	—	—	—	41 660	1 977 698	18 869
Catégorie AH1 (USD)	865 420	9 166 087	—	—	—	—
Catégorie A2 (USD)	—	—	—	96 182	—	26 490
Catégorie C1 (USD)	7 405	—	354 659	627 776	922 334	8 927
Catégorie C2 (USD)	—	—	—	7 832	—	5 382
Catégorie I1 (EUR)	30 524	2 232 692	274 466	—	925 716	497
Catégorie I1 (GBP)	—	4 094	9 409	3 580	830 280	—
Catégorie I1 (USD)	390 845	3 018 562	444 397	497 588	1 409 328	356
Catégorie IF1 (USD)	—	—	—	50 422	—	285
Catégorie IH1 (EUR)	—	—	—	—	631 927	442
Catégorie IH1 (USD)	3 456	3 870 929	—	—	—	—
Catégorie IS1 (EUR)	40 561	692	—	—	155	—
Catégorie N1 (EUR)	—	642 826	—	—	—	—
Catégorie N1 (USD)	139 199	891 987	487 480	75 531	1 198 584	50 517
Catégorie NH1 (USD)	159 290	—	—	—	—	—
Catégorie N2 (USD)	—	—	—	37 583	—	5 477
Catégorie P1 (EUR)	—	767	14 302	—	3 576	—
Catégorie P1 (USD)	—	—	3 506	—	1 653	—
Catégorie PH1 (EUR)	—	—	2 076	—	1 763	—
Catégorie S1 (USD)	—	—	58 763	—	118 771	—
Catégorie W1 (EUR)	82 719	6 984 462	76 941	—	284 400	—
Catégorie W1 (GBP)	—	408 994	230 659	—	1 094 492	—
Catégorie W1 (USD)	28 794	1 392 451	325 712	9 437	1 228 193	82 028
Catégorie WH1 (EUR)	—	—	88 977	12 797	573 361	4 730
Catégorie WH1 (GBP)	—	84 946	13 204	4 720	155 371	3 220
Catégorie WH1 (USD)	29 839	593 645	—	—	—	—
Catégorie W2 (USD)	—	—	—	48 505	—	174 865
Catégorie Z1 (EUR)	—	115 369	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2022	77,45	61,02	39,46	16,95	46,47	—
31 janvier 2023	70,51	58,54	37,52	15,31	44,25	—
31 janvier 2024	73,98	60,11	39,88	16,28	46,86	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	49,94	—	—	22,76	—
31 janvier 2023	—	50,57	—	—	22,88	—
31 janvier 2024	—	—(a)	—	—	—(a)	—

	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund \$	Global Credit Fund \$	Global Equity Fund \$	Global Equity Income Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2022	41,76	34,88	69,91	13,30	82,24	16,26
31 janvier 2023	36,79	32,38	64,33	11,63	75,79	16,43
31 janvier 2024	38,37	33,05	67,98	12,30	79,80	16,88
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (CHF)						
31 janvier 2022	—	23,96	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	22,81	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	22,90	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	10,79	41,31	14,42
31 janvier 2023	—	—	—	9,19	36,71	14,14
31 janvier 2024	—	—	—	9,52	37,83	14,25
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (USD)						
31 janvier 2022	21,14	25,17	—	—	—	—
31 janvier 2023	19,85	24,84	—	—	—	—
31 janvier 2024	21,18	26,02	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	10,00	—	14,90
31 janvier 2023	—	—	—	8,52	—	14,75
31 janvier 2024	—	—	—	8,68	—	14,86
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	13,18
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	12,63
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	—(a)
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2022	15,72	—	57,95	11,79	68,24	15,49
31 janvier 2023	13,75	—	52,92	10,21	62,41	15,54
31 janvier 2024	14,23	—	55,51	10,68	65,21	15,85
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie CH1 (USD)						
31 janvier 2022	19,03	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	17,76	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	—(a)	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	9,70	—	14,76
31 janvier 2023	—	—	—	8,28	—	14,60
31 janvier 2024	—	—	—	8,42	—	14,72
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2022	528,38	441,50	468,27	—	441,22	172,99
31 janvier 2023	485,92	427,72	449,61	—	424,33	182,42
31 janvier 2024	514,86	443,58	482,72	—	453,83	190,48
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	359,10	460,79	166,81	502,66	—
31 janvier 2023	—	367,24	467,04	160,22	510,31	—
31 janvier 2024	—	368,31	484,92	165,94	527,80	—

	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund \$	Global Credit Fund \$	Global Equity Fund \$	Global Equity Income Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2022	20,37	21,57	441,23	144,54	416,62	172,98
31 janvier 2023	18,14	20,22	409,96	127,27	387,72	176,53
31 janvier 2024	19,10	20,85	437,55	135,48	412,21	183,23
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IF1 (USD)						
31 janvier 2024	—	—	—	135,64(a)	—	183,52(a)
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	400,96	153,47
31 janvier 2023	—	—	—	—	356,19	151,73
31 janvier 2024	—	—	—	—	370,26	154,74
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (USD)						
31 janvier 2022	195,29	27,50	—	—	—	—
31 janvier 2023	185,16	27,45	—	—	—	—
31 janvier 2024	199,99	28,99	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS1 (EUR)						
31 janvier 2022	531,61	445,78	—	—	445,97	—
31 janvier 2023	489,95	432,51	—	—	429,55	—
31 janvier 2024	520,20	449,37	—	—	460,12	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	24,04	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	22,94	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	23,44	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie NH1 (USD)						
31 janvier 2022	19,29	20,23	23,26	11,01	21,02	15,74
31 janvier 2023	16,91	18,69	21,30	9,57	19,27	15,82
31 janvier 2024	17,54	18,98	22,39	10,07	20,19	16,18
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie NH1 (USD)						
31 janvier 2022	19,39	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	18,14	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	19,29	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	9,27	—	14,81
31 janvier 2023	—	—	—	7,91	—	14,65
31 janvier 2024	—	—	—	8,05	—	14,77
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	39,45	—	46,46	—
31 janvier 2023	—	—	37,51	—	44,24	—
31 janvier 2024	—	60,11(b)	39,87	—	46,86	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	69,88	—	82,22	—
31 janvier 2023	—	—	64,30	—	75,76	—
31 janvier 2024	—	—	67,95	—	79,75	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	36,99	—	41,06	—
31 janvier 2023	—	—	32,76	—	36,49	—
31 janvier 2024	—	—	33,84	—	37,59	—

STATISTIQUES — (suite)	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund \$	Global Credit Fund \$	Global Equity Fund \$	Global Equity Income Fund \$
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	89,20	—	102,84	—
31 janvier 2023	—	—	82,93	—	95,62	—
31 janvier 2024	—	—	88,56	—	101,58	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2022	23,70	24,40	40,65	—	47,86	—
31 janvier 2023	21,74	23,58	38,93	—	45,92	—
31 janvier 2024	22,98	24,40	41,70	—	48,99	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	19,87	22,21	—	21,16	—
31 janvier 2023	—	20,27	22,46	—	21,43	—
31 janvier 2024	—	20,28	23,26	—	22,11	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2022	17,51	31,95	19,88	14,33	35,13	17,23
31 janvier 2023	15,54	29,88	18,43	12,60	32,61	17,57
31 janvier 2024	16,33	30,73	19,61	13,40	34,59	18,22
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (CHF)						
31 janvier 2022	—	17,54	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	16,81	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	—(a)	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	17,38	11,79	16,50	14,86
31 janvier 2023	—	—	15,50	10,09	14,78	14,67
31 janvier 2024	—	—	16,13	10,53	15,35	14,95
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	28,67	28,53	12,95	27,38	15,80
31 janvier 2023	—	28,03	25,78	11,21	24,81	15,78
31 janvier 2024	—	29,35	27,21	11,86	26,10	16,29
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (USD)						
31 janvier 2022	21,30	19,49	—	—	—	—
31 janvier 2023	20,18	19,42	—	—	—	—
31 janvier 2024	21,71	20,49	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	9,31	—	14,88
31 janvier 2023	—	—	—	7,94	—	14,71
31 janvier 2024	—	—	—	8,08	—	14,84
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	365,78	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	357,38	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	373,80	—	—	—	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5)						
Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024 :						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	2,00	1,91	2,05	1,20	1,91	—
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	2,00	1,91	2,05	1,20	1,90	1,70
Frais sur encours - Catégorie AH1 (CHF)	—	1,94	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	—	—	—	1,20	1,94	1,70

	European Smaller Companies Fund €	European Value Fund €	Global Concentrated Fund \$	Global Credit Fund \$	Global Equity Fund \$	Global Equity Income Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Frais sur encours - Catégorie AH1 (USD)	2,03	1,93	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	—	—	—	1,20	—	1,70
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,75	—	2,80	2,20	2,66	2,45
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	—	—	—	2,20	—	2,45
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	1,00	0,92	1,06	—	0,92	0,70
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	—	0,92	1,06	0,50	0,92	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	1,00	0,92	1,06	0,50	0,92	0,70
Frais sur encours - Catégorie IF1 (USD)	—	—	—	0,35(e)	—	0,50(e)
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	—	—	—	—	0,94	0,70
Frais sur encours - Catégorie IH1 (USD)	1,00	0,94	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IS1 (EUR)	0,80	0,77	—	—	0,77	—
Frais sur encours - Catégorie N1 (EUR)	—	2,41	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,50	2,41	2,55	1,70	2,41	2,20
Frais sur encours - Catégorie NH1 (USD)	2,54	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	—	—	—	1,70	—	2,20
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	—	—	2,05	—	1,91	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	—	2,05	—	1,91	—
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	—	2,15	—	2,05	—
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	—	—	1,00	—	1,00	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	1,25	1,16	1,31	—	1,16	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	—	1,16	1,30	—	1,17	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	1,25	1,16	1,30	0,60	1,16	0,80
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	—	—	1,33	0,60	1,20	0,80
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	—	1,21	1,35	0,60	1,20	0,80
Frais sur encours - Catégorie WH1 (USD)	1,25	1,19	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	—	—	—	0,60	—	0,80
Frais sur encours - Catégorie Z1 (EUR)	—	0,07	—	—	—	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%)						
Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024	(17)	15	9	189	(14)	66

(a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.

(b) Pour de plus amples informations, voir la Note 19.

(e) Annualisés.

	Global High Yield Fund \$	Global Intrinsic Value Fund \$	Global Listed Infrastructure Fund(c) \$	Global New Discovery Fund \$	Global Opportunistic Bond Fund \$	Global Research Focused Fund \$
STATISTIQUES						
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2022	319 266 758	168 906 251	—	7 082 932	534 745 341	161 906 062
31 janvier 2023	237 646 971	95 532 751	—	6 075 335	348 722 124	137 565 041
31 janvier 2024	235 069 549	71 275 428	2 292 101	5 940 173	442 764 015	130 045 529
Actions en circulation au 31 janvier 2024						
Catégorie A1 (EUR)	393 370	366 827	4 627	34 062	139 625	21 921
Catégorie A1 (USD)	2 052 537	1 590 697	5 000	231 145	9 011 589	1 883 935
Catégorie AH1 (EUR)	—	117 696	4 626	7 359	1 283 151	—
Catégorie A2 (USD)	9 138 995	—	—	—	568 213	—
Catégorie C1 (USD)	1 181 740	506 437	5 000	34 728	3 494 355	186 809
Catégorie C2 (USD)	4 331 658	—	—	—	166 168	—
Catégorie I1 (EUR)	—	19 073	463	769	—	4 245
Catégorie I1 (GBP)	—	10 009	396	1 119	—	204
Catégorie I1 (JPY)	—	—	—	—	—	31 678
Catégorie I1 (USD)	32 849	40 352	16 000	16 000	624 680	30 136
Catégorie IF1 (USD)	—	—	500	532	—	—
Catégorie IH1 (CHF)	—	—	—	—	439	—
Catégorie IH1 (EUR)	—	41 238	463	421	46 190	—
Catégorie IH1 (GBP)	—	—	—	—	65 820	—
Catégorie IH1 (JPY)	—	—	—	—	886	19 328
Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	4 087	—
Catégorie IH2 (GBP)	—	—	—	—	76 153	—
Catégorie IS1 (USD)	215	—	—	—	453	—
Catégorie IS2 (USD)	222	—	—	—	—	—
Catégorie ISH1 (EUR)	450	—	—	—	3 476	—
Catégorie ISH2 (GBP)	402	—	—	—	460	—
Catégorie N1 (USD)	1 193 369	449 709	5 000	46 461	2 739 232	31 345
Catégorie N2 (USD)	836 823	—	—	—	85 074	—
Catégorie P1 (EUR)	—	126 651	—	4 451	117 019	—
Catégorie P1 (USD)	—	—	—	—	27 111	—
Catégorie PH1 (EUR)	—	4 719	—	—	174 307	—
Catégorie S1 (USD)	193 067	—	—	—	—	191 613
Catégorie W1 (EUR)	—	36 541	—	—	20 949	—
Catégorie W1 (GBP)	—	64 219	—	5 085	—	—
Catégorie W1 (USD)	520 360	23 264	5 000	20 459	6 636 581	83 012
Catégorie WH1 (EUR)	282 132	11 816	4 626	7 724	181 364	—
Catégorie WH1 (GBP)	4 453	3 890	3 962	6 208	37 256	—
Catégorie W2 (USD)	242 998	—	—	—	92 336	—
Catégorie WS1 (USD)	2 584	—	—	—	4 994 723	—
Catégorie WS2 (USD)	6 122	—	—	—	4 637	—
Catégorie WSH1 (EUR)	3 885	—	—	—	1 112 636	—
Catégorie WSH2 (EUR)	3 990	—	—	—	4 924	—
Catégorie WSH2 (GBP)	3 327	—	—	—	174 350	—
Catégorie Z1 (USD)	—	—	—	—	500	—

	Global High Yield Fund \$	Global Intrinsic Value Fund \$	Global Listed Infrastructure Fund(c) \$	Global New Discovery Fund \$	Global Opportunistic Bond Fund \$	Global Research Focused Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2022	21,21	15,51	—	11,36	11,34	30,36
31 janvier 2023	20,78	14,59	—	10,23	10,92	28,12
31 janvier 2024	22,79	16,28	10,31	10,90	11,43	31,27
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2022	32,67	15,44	—	10,57	11,50	46,80
31 janvier 2023	30,98	14,05	—	9,21	10,70	41,95
31 janvier 2024	33,78	15,59	10,39	9,76	11,14	46,37
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	14,60	—	10,42	10,24	—
31 janvier 2023	—	12,84	—	8,77	9,30	—
31 janvier 2024	—	13,95	10,31	9,08	9,49	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (EUR)						
31 janvier 2022	12,73	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	11,93	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	—(a)	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2022	5,77	—	—	—	10,31	—
31 janvier 2023	5,23	—	—	—	9,36	—
31 janvier 2024	5,41	—	—	—	9,41	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH2 (EUR)						
31 janvier 2022	8,91	—	—	—	9,19	—
31 janvier 2023	7,88	—	—	—	8,15	—
31 janvier 2024	—(a)	—	—	—	—(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2022	25,87	15,10	—	10,48	10,89	38,94
31 janvier 2023	24,29	13,64	—	9,06	10,03	34,65
31 janvier 2024	26,22	15,01	10,36	9,53	10,34	38,01
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2022	5,83	—	—	—	10,29	—
31 janvier 2023	5,29	—	—	—	9,34	—
31 janvier 2024	5,47	—	—	—	9,40	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	160,38	—	114,95	—	378,37
31 janvier 2023	—	152,47	—	104,59	—	354,34
31 janvier 2024	—	172,01	103,54	112,57	—	398,30
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	152,06	—	106,64	—	360,93
31 janvier 2023	—	152,62	—	102,42	—	356,82
31 janvier 2024	—	166,49	102,80	106,61	—	387,87
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (JPY)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	21 329
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	21 863
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	27 624

	Global High Yield Fund \$	Global Intrinsic Value Fund \$	Global Listed Infrastructure Fund(c) \$	Global New Discovery Fund \$	Global Opportunistic Bond Fund \$	Global Research Focused Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2022	236,97	159,58	—	106,94	119,33	347,15
31 janvier 2023	226,55	146,81	—	94,15	111,80	314,60
31 janvier 2024	248,97	164,64	104,37	100,74	117,11	351,53
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IF1 (USD)						
31 janvier 2024	—	—	104,47	100,98(a)	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (CHF)						
31 janvier 2024	—	—	—	—	104,05(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	150,76	—	105,38	106,57	—
31 janvier 2023	—	133,84	—	88,70	97,73	—
31 janvier 2024	—	147,05	103,51	92,85	100,44	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	112,19	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	103,79	—
31 janvier 2024	—	—	—	—	108,10	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (JPY)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	10 097	17 630
31 janvier 2023	—	—	—	—	9 204	15 445
31 janvier 2024	—	—	—	—	9 175	16 328
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	100,59	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	89,33	—
31 janvier 2024	—	—	—	—	88,15	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH2 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	105,92	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	95,23	—
31 janvier 2024	—	—	—	—	95,15	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	113,04	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	102,68	—
31 janvier 2024	—	—	—	—	—(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS1 (USD)						
31 janvier 2024	249,28(a)	—	—	—	117,37(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS2 (USD)						
31 janvier 2024	242,63(a)	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISH1 (EUR)						
31 janvier 2024	106,10(a)	—	—	—	100,77(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ISH2 (GBP)						
31 janvier 2024	103,47(a)	—	—	—	95,65(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2022	13,18	15,21	—	10,52	11,18	17,10
31 janvier 2023	12,44	13,77	—	9,12	10,36	15,25
31 janvier 2024	13,49	15,20	10,37	9,61	10,73	16,77

	Global High Yield Fund \$	Global Intrinsic Value Fund \$	Global Listed Infrastructure Fund(c) \$	Global New Discovery Fund \$	Global Opportunistic Bond Fund \$	Global Research Focused Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2022	9,15	—	—	—	10,30	—
31 janvier 2023	8,30	—	—	—	9,35	—
31 janvier 2024	8,59	—	—	—	9,41	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	15,50	—	—	11,35	—
31 janvier 2023	—	14,58	—	—	10,92	—
31 janvier 2024	—	16,27	—	10,90(a)	11,43	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	11,49	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	10,70	—
31 janvier 2024	—	—	—	—	11,14	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	14,58	—	—	10,25	—
31 janvier 2023	—	12,79	—	—	9,34	—
31 janvier 2024	—	13,90	—	—	9,55	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2022	15,23	—	—	—	—	57,43
31 janvier 2023	14,51	—	—	—	—	51,91
31 janvier 2024	15,89	—	—	—	—	57,86
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	15,99	—	—	11,61	—
31 janvier 2023	—	15,19	—	—	11,23	—
31 janvier 2024	—	17,12	—	—	11,82	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	15,15	—	10,65	—	—
31 janvier 2023	—	15,19	—	10,22	—	—
31 janvier 2024	—	16,56	—	10,63	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2022	19,85	15,90	—	10,68	11,85	31,33
31 janvier 2023	18,96	14,61	—	9,39	11,11	28,37
31 janvier 2024	20,82	16,37	10,43	10,04	11,62	31,67
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2022	12,51	15,02	—	10,53	10,63	—
31 janvier 2023	11,68	13,31	—	8,95	9,69	—
31 janvier 2024	12,60	14,61	10,35	9,34	9,95	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2022	12,55	15,22	—	10,60	11,13	—
31 janvier 2023	11,89	13,64	—	9,11	10,38	—
31 janvier 2024	13,00	15,19	10,40	9,65	10,81	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2022	9,33	—	—	—	10,28	—
31 janvier 2023	8,47	—	—	—	9,33	—
31 janvier 2024	8,76	—	—	—	9,39	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WS1 (USD)						
31 janvier 2024	20,84(a)	—	—	—	11,65(a)	—

	Global High Yield Fund \$	Global Intrinsic Value Fund \$	Global Listed Infrastructure Fund(c) \$	Global New Discovery Fund \$	Global Opportunistic Bond Fund \$	Global Research Focused Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WS2 (USD)						
31 janvier 2024	8,80(a)	—	—	—	11,43(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WSH1 (EUR)						
31 janvier 2024	12,61(a)	—	—	—	9,98(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WSH2 (EUR)						
31 janvier 2024	12,28(a)	—	—	—	9,79(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WSH2 (GBP)						
31 janvier 2024	12,67(a)	—	—	—	10,42(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	122,38	—
31 janvier 2023	—	—	—	—	115,25	—
31 janvier 2024	—	—	—	—	121,30	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5)						
Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024 :						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	1,40	1,85	1,85(e)	1,85	1,20	1,85
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,40	1,85	1,85(e)	1,85	1,20	1,84
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	—	1,85	1,85(e)	1,85	1,20	—
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	1,40	—	—	—	1,20	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,40	2,60	2,60(e)	2,60	2,20	2,59
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	2,40	—	—	—	2,20	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	—	0,75	0,75(e)	0,85	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	—	0,75	0,75(e)	0,85	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie I1 (JPY)	—	—	—	—	—	0,75
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,60	0,75	0,75(e)	0,85	0,55	0,75
Frais sur encours - Catégorie IF1 (USD)	—	—	0,50(e)	0,55(e)	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (CHF)	—	—	—	—	0,55(e)	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	—	0,75	0,75(e)	0,85	0,55	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (GBP)	—	—	—	—	0,55	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (JPY)	—	—	—	—	0,55	0,75
Frais sur encours - Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	0,55	—
Frais sur encours - Catégorie IH2 (GBP)	—	—	—	—	0,55	—
Frais sur encours - Catégorie IS1 (USD)	0,35(e)	—	—	—	0,31(e)	—
Frais sur encours - Catégorie IS2 (USD)	0,35(e)	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie ISH1 (EUR)	0,38(e)	—	—	—	0,34(e)	—
Frais sur encours - Catégorie ISH2 (GBP)	0,38(e)	—	—	—	0,34(e)	—
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	1,90	2,35	2,35(e)	2,35	1,70	2,35
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	1,90	—	—	—	1,70	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	—	1,85	—	1,85(e)	1,20	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	—	—	—	1,20	—
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	1,85	—	—	1,20	—
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	0,96	—	—	—	—	1,00
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	—	0,85	—	—	0,65	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	—	0,85	—	0,95	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	0,70	0,85	0,85(e)	0,95	0,65	0,85
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	0,70	0,85	0,85(e)	0,95	0,65	—

	Global Total Return Fund \$	Global High Yield Fund \$	Global Listed Infrastructure Fund(c) \$	Global Intrinsic Value Fund \$	Global Opportunistic Bond Fund \$	Global Research Focused Fund \$
STATISTIQUES						
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	0,70	0,85	0,85(e)	0,95	0,65	—
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	0,70	—	—	—	0,65	—
Frais sur encours - Catégorie WS1 (USD)	0,39(e)	—	—	—	0,35(e)	—
Frais sur encours - Catégorie WS2 (USD)	0,39(e)	—	—	—	0,35(e)	—
Frais sur encours - Catégorie WSH1 (EUR)	0,42(e)	—	—	—	0,38(e)	—
Frais sur encours - Catégorie WSH2 (EUR)	0,42(e)	—	—	—	0,38(e)	—
Frais sur encours - Catégorie WSH2 (GBP)	0,42(e)	—	—	—	0,38(e)	—
Frais sur encours - Catégorie Z1 (USD)	—	—	—	—	0,10	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%)						
Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024	47	5	12(f)	55	192	35

(b) Le compartiment a commencé ses activités le 18 mai 2022.

(c) Le compartiment a commencé ses activités le 13 Septembre 2023.

(e) Annualisés.

(f) Non annualisés.

	Global Strategic Equity Fund \$	Global Total Return Fund \$	Inflation- Adjusted Bond Fund \$	Japan Equity Fund(c) ¥	Limited Maturity Fund \$	Managed Wealth Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2022	—	1 921 098 164	276 944 572	4 486 493	981 111 512	20 213 212
31 janvier 2023	2 422 063	1 693 918 338	208 170 499	374 401 338	858 924 626	19 263 694
31 janvier 2024	3 354 985	1 495 237 740	131 012 417	481 658 833	1 127 175 507	13 965 346
Actions en circulation au 31 janvier 2024						
Catégorie A1 (EUR)	5 514	6 707 148	—	9 779	371 622	—
Catégorie A1 (USD)	22 878	13 394 330	4 329 502	59 244	34 455 060	797 939
Catégorie AH1 (EUR)	6 037	1 366 562	—	—	—	6 444
Catégorie A2 (USD)	—	3 158 220	918 481	—	2 758 985	—
Catégorie A4 (EUR)	—	41 146	—	—	—	—
Catégorie C1 (USD)	5 873	6 152 451	975 711	10 930	6 963 491	15 328
Catégorie C2 (USD)	—	2 127 165	270 264	—	2 352 134	—
Catégorie I1 (EUR)	551	—	—	1 553	—	442
Catégorie I1 (GBP)	469	3 844	—	151	—	322
Catégorie I1 (JPY)	—	—	—	659	—	—
Catégorie I1 (USD)	16 500	664 190	72 143	5 908	1 761 859	41 235
Catégorie IF1 (USD)	455	—	—	—	—	—
Catégorie IH1 (EUR)	592	29 306	101 496	—	458	624
Catégorie N1 (USD)	10 310	6 911 562	435 188	4 269	5 744 636	47 373
Catégorie N2 (USD)	—	113 115	95 183	—	447 017	—
Catégorie P1 (EUR)	—	12 782	—	—	—	5 605
Catégorie P1 (USD)	—	1 559	—	—	—	5 935
Catégorie PH1 (EUR)	—	9 677	—	—	—	14 507
Catégorie S1 (USD)	—	389 726	75 769	—	830 714	—
Catégorie W1 (EUR)	—	328 747	—	—	—	—
Catégorie W1 (USD)	5 867	3 029 275	771 384	51 693	9 576 896	12 229
Catégorie WH1 (EUR)	5 922	167 834	—	—	—	6 329
Catégorie WH1 (GBP)	5 166	506 714	—	—	—	5 190
Catégorie W2 (USD)	—	642 914	116 242	—	957 170	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	25,01	—	16,64	13,51	—
31 janvier 2023	10,10	24,39	—	15,34	13,57	—
31 janvier 2024	12,56	25,24	—	16,94	14,23	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	14,58	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	15,00	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	—(a)	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2022	—	40,77	16,96	13,67	15,19	9,72
31 janvier 2023	10,44	38,47	15,54	12,20	14,76	9,64
31 janvier 2024	12,91	39,58	15,58	13,40	15,39	10,10
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	12,27	—	—	—	8,65
31 janvier 2023	10,13	11,24	—	—	—	8,39
31 janvier 2024	12,27	11,32	—	—	—	8,63

	Global Strategic Equity Fund \$	Global Total Return Fund \$	Inflation- Adjusted Bond Fund \$	Japan Equity Fund(c) ¥	Limited Maturity Fund \$	Managed Wealth Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2022	—	32,26	11,68	—	8,65	—
31 janvier 2023	—	30,17	9,93	—	8,26	—
31 janvier 2024	—	30,59	9,58	—	8,33	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	11,85	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	10,75	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	—(a)	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A4 (EUR)						
31 janvier 2022	—	12,64	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	12,24	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	12,49	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH4 (EUR)						
31 janvier 2022	—	12,15	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	11,04	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	—(a)	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2022	—	34,30	14,17	12,32	12,21	9,26
31 janvier 2023	10,38	32,10	12,84	10,91	11,74	9,12
31 janvier 2024	12,74	32,74	12,73	11,89	12,11	9,48
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2022	—	31,11	11,50	—	8,59	—
31 janvier 2023	—	29,06	9,78	—	8,20	—
31 janvier 2024	—	29,48	9,41	—	8,27	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	195,88	—	103,88
31 janvier 2023	101,78	—	—	182,61	—	107,61
31 janvier 2024	127,99	—	—	203,97	—	114,51
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	326,77	—	234,20	—	119,99
31 janvier 2023	106,24	339,69	—	230,48	—	131,10
31 janvier 2024	129,19	343,33	—	248,94	—	134,91
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (JPY)						
31 janvier 2023	—	—	—	10 124	—	—
31 janvier 2024	—	—	—	12 712	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2023	—	—	10 124(a)	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2022	—	280,40	175,70	161,11	144,29	104,14
31 janvier 2023	105,01	267,23	161,70	145,34	141,16	104,29
31 janvier 2024	131,27	277,65	162,94	161,37	148,11	110,32
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IF1 (USD)						
31 janvier 2024	131,53(a)	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	134,97	—	—	—	93,22
31 janvier 2023	101,76	124,71	97,72	—	—	91,00
31 janvier 2024	124,50	126,86	96,49	—	103,14(a)	94,49

	Global Strategic Equity Fund \$	Global Total Return Fund \$	Inflation- Adjusted Bond Fund \$	Japan Equity Fund(c) ¥	Limited Maturity Fund \$	Managed Wealth Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2022	—	15,42	10,72	13,68	10,33	9,40
31 janvier 2023	10,40	14,46	9,76	12,14	9,98	9,28
31 janvier 2024	12,80	14,79	9,73	13,27	10,35	9,68
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2022	—	14,09	9,73	—	9,67	—
31 janvier 2023	—	13,17	8,25	—	9,23	—
31 janvier 2024	—	13,35	7,95	—	9,32	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	25,00	—	—	—	9,15
31 janvier 2023	—	24,38	—	—	—	9,38
31 janvier 2024	—	25,23	—	—	—	9,89
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2022	—	40,78	—	—	—	9,72
31 janvier 2023	—	38,48	—	—	—	9,64
31 janvier 2024	—	39,59	—	—	—	10,10
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	12,24	—	—	—	8,64
31 janvier 2023	—	11,17	—	—	—	8,35
31 janvier 2024	—	11,23	—	—	—	8,60
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2022	—	44,22	17,54	—	13,69	—
31 janvier 2023	—	42,08	16,11	—	13,35	—
31 janvier 2024	—	43,65	16,21	—	13,98	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	14,59	—	—	—	—
31 janvier 2023	—	14,32	—	—	—	—
31 janvier 2024	—	14,91	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2022	—	22,28	14,48	13,79	12,15	10,35
31 janvier 2023	10,51	21,16	13,32	12,43	11,87	10,39
31 janvier 2024	13,13	21,91	13,41	13,79	12,45	10,98
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2022	—	13,26	—	—	—	9,28
31 janvier 2023	10,17	12,22	—	—	—	9,05
31 janvier 2024	12,43	12,37	—	—	—	9,39
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	14,79	—	—	—	9,77
31 janvier 2023	10,22	13,83	—	—	—	9,69
31 janvier 2024	12,68	14,16	—	—	—	10,20
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2022	—	15,99	9,38	—	9,65	—
31 janvier 2023	—	14,95	7,99	—	9,21	—
31 janvier 2024	—	15,16	7,71	—	9,30	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5)						
Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024 :						

	Global Strategic Equity Fund \$	Global Total Return Fund \$	Inflation- Adjusted Bond Fund \$	Japan Equity Fund(c) ¥	Limited Maturity Fund \$	Managed Wealth Fund \$
STATISTIQUES						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	1,85	1,84	—	1,85	1,14	—
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,85	1,84	0,98	1,85	1,15	1,90
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	1,85	1,88	—	—	—	1,90
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	—	1,83	0,98	—	1,14	—
Frais sur encours - Catégorie A4 (EUR)	—	1,84	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,60	2,69	2,08	2,60	2,25	2,65
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	—	2,69	2,08	—	2,25	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	0,75	—	—	0,75	—	0,95
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	0,75	0,85	—	0,75	—	0,95
Frais sur encours - Catégorie I1 (JPY)	—	—	—	0,75	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,75	0,85	0,50	0,76	0,51	0,94
Frais sur encours - Catégorie IF1 (USD)	0,50(e)	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	0,75	0,90	0,50	—	0,51(e)	0,95
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,35	2,44	1,58	2,35	1,75	2,40
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	—	2,44	1,58	—	1,75	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	—	1,85	—	—	—	1,90
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	1,84	—	—	—	1,90
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	1,95	—	—	—	1,90
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	—	1,00	0,69	—	0,71	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	—	1,19	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	0,85	1,19	0,58	0,85	0,61	1,05
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	0,85	1,24	—	—	—	1,05
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	0,85	1,25	—	—	—	1,05
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	—	1,19	0,58	—	0,61	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%)						
Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024	50	117	54	56	86	41

(a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.

(c) À compter du 7 juin 2022, la devise de référence du Japan Equity Fund a été modifiée, passant du dollar américain au yen japonais. Toutes les valeurs nettes d'inventaire et les valeurs nettes d'inventaire par action de l'exercice précédent sont exprimées en dollars américains.

(e) Annualisés.

	Prudent Capital Fund \$	Prudent Wealth Fund \$	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund \$	U.S. Corporate Bond Fund \$	U.S. Government Bond Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire						
31 janvier 2022	5 308 833 585	4 982 416 168	24 127 159	530 284 123	435 210 111	304 900 123
31 janvier 2023	3 832 329 146	3 572 470 531	21 853 803	456 301 825	399 977 381	346 661 165
31 janvier 2024	3 364 158 903	2 909 668 091	16 384 276	459 678 673	585 530 492	353 066 654
Actions en circulation au 31 janvier 2024						
Catégorie A1 (EUR)	36 275 556	30 350 679	—	—	—	3 051 096
Catégorie A1 (USD)	63 933 557	34 368 672	359 605	6 741 359	15 543 539	5 293 780
Catégorie AH1 (CHF)	116 965	—	—	—	—	—
Catégorie AH1 (EUR)	15 597 321	17 113 116	—	—	212 677	6 920 981
Catégorie A2 (USD)	—	—	—	—	5 245 736	2 334 449
Catégorie A4 (EUR)	3 722 600	—	—	—	—	—
Catégorie C1 (USD)	29 338 582	15 634 094	230 981	1 951 494	5 260 039	870 496
Catégorie C2 (USD)	—	—	—	—	1 250 786	242 701
Catégorie I1 (EUR)	2 288 568	758 922	—	—	—	—
Catégorie I1 (GBP)	144 684	14 582	9 458	654	—	—
Catégorie I1 (USD)	1 806 668	260 950	271 445	29 502	796 869	242 612
Catégorie IH1 (EUR)	969 074	1 054 618	—	—	3 032	—
Catégorie IH1R (USD)	35 635	—	—	—	—	—
Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	—	333 150
Catégorie I2 (GBP)	—	—	1 528	—	—	—
Catégorie N1 (USD)	13 792 628	8 847 279	70 637	1 070 756	2 972 115	595 173
Catégorie N2 (USD)	—	—	—	—	511 711	95 774
Catégorie P1 (EUR)	3 762 055	—	—	—	—	—
Catégorie P1 (USD)	923 076	—	—	—	—	—
Catégorie PH1 (EUR)	1 265 765	—	—	—	—	—
Catégorie S1 (USD)	439	—	—	919 523	—	316 704
Catégorie W1 (EUR)	5 781 346	517 750	—	—	—	—
Catégorie W1 (GBP)	853 822	280 414	210 115	—	—	—
Catégorie W1 (USD)	8 160 818	5 116 543	12 972	663 890	5 869 126	1 987 988
Catégorie WH1 (EUR)	2 248 754	1 669 700	—	6 433	459 667	—
Catégorie WH1 (GBP)	131 056	141 762	—	19 028	196 679	—
Catégorie W2 (USD)	—	—	—	—	5 266 450	415 451
Catégorie ZH1 (JPY)	83 315	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (EUR)						
31 janvier 2022	13,36	24,65	—	—	—	12,25
31 janvier 2023	12,71	22,74	—	—	—	11,57
31 janvier 2024	13,90	24,86	—	—	—	11,66
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	10,66	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	10,80	—	—	—
31 janvier 2024	—	—	—(a)	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)						
31 janvier 2022	13,52	22,22	18,30	38,57	13,10	18,50
31 janvier 2023	12,44	19,84	17,00	34,50	11,74	16,90
31 janvier 2024	13,53	21,55	16,88	39,26	12,17	16,94

	Prudent Capital Fund \$	Prudent Wealth Fund \$	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund \$	U.S. Corporate Bond Fund \$	U.S. Government Bond Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (CHF)						
31 janvier 2022	9,83	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	8,73	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	9,10	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)						
31 janvier 2022	12,13	15,68	—	—	11,53	11,62
31 janvier 2023	10,84	13,57	—	—	10,05	10,33
31 janvier 2024	11,53	14,47	—	—	10,22	10,13
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,55	10,27
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,19	9,21
31 janvier 2024	—	—	—	—	9,18	8,96
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A4 (EUR)						
31 janvier 2022	12,81	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	12,16	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	13,17	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH4 (EUR)						
31 janvier 2022	12,26	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	10,91	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	—(a)	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)						
31 janvier 2022	13,00	19,86	10,60	32,49	11,97	14,85
31 janvier 2023	11,87	17,60	9,77	28,83	10,62	13,42
31 janvier 2024	12,81	18,98	9,62	32,56	10,90	13,30
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,56	10,29
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,20	9,22
31 janvier 2024	—	—	—	—	9,19	8,97
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)						
31 janvier 2022	141,69	274,90	—	—	—	—
31 janvier 2023	136,21	256,14	—	—	—	—
31 janvier 2024	150,64	282,73	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)						
31 janvier 2022	131,49	268,29	245,88	634,30	—	—
31 janvier 2023	133,45	263,90	251,85	624,76	—	—
31 janvier 2024	142,72	281,69	245,98	698,40	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)						
31 janvier 2022	143,32	250,41	12,94	526,26	139,36	168,85
31 janvier 2023	133,33	225,79	12,15	475,16	125,80	154,99
31 janvier 2024	146,58	247,75	12,19	546,02	131,45	156,08
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)						
31 janvier 2022	127,97	172,39	—	—	181,89	—
31 janvier 2023	115,78	151,13	—	—	160,25	—
31 janvier 2024	124,74	162,33	—	—	164,03	—

	Prudent Capital Fund \$	Prudent Wealth Fund \$	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund \$	U.S. Corporate Bond Fund \$	U.S. Government Bond Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1R (USD)						
31 janvier 2022	117,71	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	125,35	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	149,08	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH2 (EUR)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	—	126,94
31 janvier 2023	—	—	—	—	—	111,03
31 janvier 2024	—	—	—	—	—	105,76
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I2 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	131,31	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	129,93	—	—	—
31 janvier 2024	—	—	122,62	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)						
31 janvier 2022	13,16	17,04	11,11	30,73	12,52	10,55
31 janvier 2023	12,05	15,14	10,27	27,34	11,16	9,58
31 janvier 2024	13,04	16,37	10,15	30,95	11,52	9,54
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,56	9,47
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,20	8,48
31 janvier 2024	—	—	—	—	9,19	8,26
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (EUR)						
31 janvier 2022	13,36	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	12,71	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	13,90	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)						
31 janvier 2022	13,52	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	12,44	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	13,53	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)						
31 janvier 2022	12,07	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	10,80	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	11,52	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)						
31 janvier 2022	142,44	—	—	47,92	—	16,72
31 janvier 2023	132,28	—	—	43,29	—	15,33
31 janvier 2024	145,17	—	—	49,79	—	15,41
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (EUR)						
31 janvier 2022	13,90	25,39	—	—	—	—
31 janvier 2023	13,35	23,61	—	—	—	—
31 janvier 2024	14,75	25,99	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (GBP)						
31 janvier 2022	13,08	17,51	19,21	—	—	—
31 janvier 2023	13,26	17,18	19,66	—	—	—
31 janvier 2024	14,18	18,29	19,18	—	—	—

	Prudent Capital Fund \$	Prudent Wealth Fund \$	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund \$	U.S. Corporate Bond Fund \$	U.S. Government Bond Fund \$
STATISTIQUES — (suite)						
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)						
31 janvier 2022	14,27	21,78	12,39	50,63	13,80	12,98
31 janvier 2023	13,26	19,60	11,60	45,68	12,44	11,91
31 janvier 2024	14,56	21,45	11,63	52,45	12,99	11,98
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (CHF)						
31 janvier 2022	9,94	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	8,94	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	—(a)	—	—	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)						
31 janvier 2022	12,89	13,80	—	22,91	11,50	—
31 janvier 2023	11,63	12,06	—	19,92	10,13	—
31 janvier 2024	12,50	12,95	—	22,36	10,37	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)						
31 janvier 2022	13,31	21,14	—	36,48	12,28	—
31 janvier 2023	12,17	18,70	—	32,05	10,97	—
31 janvier 2024	13,29	20,35	—	36,60	11,38	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (GBP)						
31 janvier 2022	—	—	13,61	—	—	—
31 janvier 2023	—	—	13,51	—	—	—
31 janvier 2024	—	—	—(a)	—	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)						
31 janvier 2022	—	—	—	—	10,58	9,29
31 janvier 2023	—	—	—	—	9,21	8,32
31 janvier 2024	—	—	—	—	9,22	8,10
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie ZH1 (JPY)						
31 janvier 2022	11 842	—	—	—	—	—
31 janvier 2023	10 716	—	—	—	—	—
31 janvier 2024	11 212	—	—	—	—	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5)						
Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024 :						
Frais sur encours - Catégorie A1 (EUR)	1,92	2,01	—	—	—	0,99
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,92	2,01	1,85	2,04	1,25	0,99
Frais sur encours - Catégorie AH1 (CHF)	2,02	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	1,94	2,03	—	—	1,25	0,99
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	—	—	—	—	1,25	0,98
Frais sur encours - Catégorie A4 (EUR)	1,92	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,67	2,76	2,60	2,82	2,25	2,09
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	—	—	—	—	2,25	2,09
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	0,83	1,02	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	0,83	1,02	0,75	1,08	—	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,83	1,02	0,75	1,08	0,50	0,51
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	0,85	1,04	—	—	0,50	—
Frais sur encours - Catégorie IH1R (USD)	0,85	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie IH2 (EUR)	—	—	—	—	—	0,51
Frais sur encours - Catégorie I2 (GBP)	—	—	0,75	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,42	2,51	2,35	2,57	1,75	1,59

	Prudent Capital Fund \$	Prudent Wealth Fund \$	U.K. Equity Fund £	U.S. Concentrated Growth Fund \$	U.S. Corporate Bond Fund \$	U.S. Government Bond Fund \$
STATISTIQUES						
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	—	—	—	—	1,75	1,59
Frais sur encours - Catégorie P1 (EUR)	1,92	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	1,92	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	1,95	—	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	1,00	—	—	1,00	—	0,65
Frais sur encours - Catégorie W1 (EUR)	0,92	1,26	—	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (GBP)	0,93	1,27	0,85	—	—	—
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	0,92	1,26	0,85	1,15	0,60	0,59
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	0,95	1,29	—	1,15	0,60	—
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	0,98	1,30	—	1,15	0,60	—
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	—	—	—	—	0,60	0,59
Frais sur encours - Catégorie ZH1 (JPY)	0,09	—	—	—	—	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024	59	70	(28)	37	66	261

(a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.

	U.S. Growth Fund \$	U.S. Total Return Bond Fund \$	U.S. Value Fund \$
STATISTIQUES — (suite)			
Valeur nette d'inventaire			
31 janvier 2022	54 610 058	604 718 147	2 494 488 317
31 janvier 2023	46 029 396	443 230 862	2 206 675 204
31 janvier 2024	56 994 975	897 477 842	1 819 082 867
Actions en circulation au 31 janvier 2024			
Catégorie A1 (USD)	1 022 966	7 144 041	18 920 591
Catégorie AH1 (EUR)	5 213	95 227	667 121
Catégorie A2 (USD)	—	2 285 632	—
Catégorie C1 (USD)	298 002	2 150 296	4 930 602
Catégorie C2 (USD)	—	839 046	—
Catégorie I1 (EUR)	582	—	20 074
Catégorie I1 (GBP)	414	—	4 656
Catégorie I1 (USD)	72 693	917 553	856 022
Catégorie IH1 (EUR)	447	417 974	14 719
Catégorie IS1 (USD)	—	2 306 151	—
Catégorie N1 (USD)	256 836	2 293 820	3 980 269
Catégorie N2 (USD)	—	267 237	—
Catégorie P1 (USD)	—	—	5 040
Catégorie PH1 (EUR)	—	—	2 562
Catégorie S1 (USD)	—	161 219	801 732
Catégorie W1 (USD)	37 499	3 546 691	11 383 654
Catégorie WH1 (EUR)	5 695	4 730	904 599
Catégorie WH1 (GBP)	4 140	4 928	29 439
Catégorie W2 (USD)	—	499 306	—
Catégorie Z1 (USD)	110 764	—	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A1 (USD)			
31 janvier 2022	15,30	19,62	38,17
31 janvier 2023	12,43	17,79	37,47
31 janvier 2024	16,08	18,18	38,85
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie AH1 (EUR)			
31 janvier 2022	14,72	10,21	23,03
31 janvier 2023	11,53	9,03	21,91
31 janvier 2024	14,58	9,04	22,24
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie A2 (USD)			
31 janvier 2022	—	10,61	—
31 janvier 2023	—	9,38	—
31 janvier 2024	—	9,25	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C1 (USD)			
31 janvier 2022	15,01	16,03	32,39
31 janvier 2023	12,10	14,39	31,56
31 janvier 2024	15,54	14,56	32,47
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie C2 (USD)			
31 janvier 2022	—	10,62	—
31 janvier 2023	—	9,39	—
31 janvier 2024	—	9,25	—

	U.S. Growth Fund \$	U.S. Total Return Bond Fund \$	U.S. Value Fund \$
STATISTIQUES — (suite)			
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (EUR)			
31 janvier 2022	155,19	—	379,66
31 janvier 2023	131,72	—	389,34
31 janvier 2024	173,33	—	410,45
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (GBP)			
31 janvier 2022	142,37	—	468,37
31 janvier 2023	127,53	—	507,03
31 janvier 2024	162,30	—	516,89
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie I1 (USD)			
31 janvier 2022	157,21	190,33	368,46
31 janvier 2023	129,09	173,86	365,64
31 janvier 2024	168,87	178,88	383,16
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IH1 (EUR)			
31 janvier 2022	151,38	107,13	257,38
31 janvier 2023	119,64	95,38	247,88
31 janvier 2024	153,10	96,16	254,19
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie IS1 (USD)			
31 janvier 2024	—	179,21(a)	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N1 (USD)			
31 janvier 2022	15,12	11,76	21,98
31 janvier 2023	12,22	10,61	21,46
31 janvier 2024	15,73	10,79	22,14
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie N2 (USD)			
31 janvier 2022	—	10,10	—
31 janvier 2023	—	8,93	—
31 janvier 2024	—	8,81	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie P1 (USD)			
31 janvier 2022	—	—	38,19
31 janvier 2023	—	—	37,48
31 janvier 2024	—	—	38,86
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie PH1 (EUR)			
31 janvier 2022	—	—	23,04
31 janvier 2023	—	—	21,97
31 janvier 2024	—	—	22,28
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie S1 (USD)			
31 janvier 2022	—	18,80	48,32
31 janvier 2023	—	17,14	47,86
31 janvier 2024	—	17,61	50,08
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W1 (USD)			
31 janvier 2022	15,68	15,37	35,44
31 janvier 2023	12,86	14,02	35,13
31 janvier 2024	16,81	14,41	36,79

	U.S. Growth Fund \$	U.S. Total Return Bond Fund \$	U.S. Value Fund \$
STATISTIQUES — (suite)			
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (EUR)			
31 janvier 2022	15,10	10,91	16,22
31 janvier 2023	11,92	9,70	15,58
31 janvier 2024	15,24	9,76	16,00
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie WH1 (GBP)			
31 janvier 2022	15,19	11,40	28,29
31 janvier 2023	12,13	10,31	27,44
31 janvier 2024	15,73	10,54	28,50
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie W2 (USD)			
31 janvier 2022	—	10,11	—
31 janvier 2023	—	8,93	—
31 janvier 2024	—	8,80	—
Valeur nette d'inventaire par action de catégorie Z1 (USD)			
31 janvier 2022	152,89	—	—
31 janvier 2023	126,42	—	—
31 janvier 2024	166,54	—	—
Frais sur encours (annualisés) (%) (Note 5) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024 :			
Frais sur encours - Catégorie A1 (USD)	1,85	1,20	1,92
Frais sur encours - Catégorie AH1 (EUR)	1,85	1,20	1,96
Frais sur encours - Catégorie A2 (USD)	—	1,20	—
Frais sur encours - Catégorie C1 (USD)	2,60	2,20	2,67
Frais sur encours - Catégorie C2 (USD)	—	2,20	—
Frais sur encours - Catégorie I1 (EUR)	0,75	—	0,83
Frais sur encours - Catégorie I1 (GBP)	0,75	—	0,83
Frais sur encours - Catégorie I1 (USD)	0,75	0,50	0,83
Frais sur encours - Catégorie IH1 (EUR)	0,75	0,50	0,87
Frais sur encours - Catégorie IS1 (USD)	—	0,28(e)	—
Frais sur encours - Catégorie N1 (USD)	2,35	1,70	2,42
Frais sur encours - Catégorie N2 (USD)	—	1,70	—
Frais sur encours - Catégorie P1 (USD)	—	—	1,92
Frais sur encours - Catégorie PH1 (EUR)	—	—	2,05
Frais sur encours - Catégorie S1 (USD)	—	0,66	1,00
Frais sur encours - Catégorie W1 (USD)	0,85	0,60	0,92
Frais sur encours - Catégorie WH1 (EUR)	0,85	0,60	0,95
Frais sur encours - Catégorie WH1 (GBP)	0,85	0,60	1,00
Frais sur encours - Catégorie W2 (USD)	—	0,60	—
Frais sur encours - Catégorie Z1 (USD)	0,05	—	—
Rotation de portefeuille (non révisée) (%) Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024			
	44	94	5

(a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.

(e) Annualisés.

Note 1 : Le Fonds

Le MFS Meridian Funds (le « fonds » ou la « Société ») est une société d'investissement à capital variable constituée en vertu des lois du Grand-Duché de Luxembourg le 4 février 1992. Elle est constituée en vertu de la Partie I de la loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010 sur les organismes de placement collectif, telle qu'amendée, sous le statut de Société Anonyme répondant aux critères d'une « Société d'investissement à capital variable » (« SICAV »). Le fonds est enregistré au Registre de Commerce et des Sociétés du Luxembourg, sous le numéro R.C.S. B 39346. Le 31 octobre 2014, il a désigné MFS Investment Management Company (Lux) S.à r.l. (« MFS Lux ») comme Société de Gestion.

Le fonds est un « fonds à compartiments multiples », c'est-à-dire qu'il est composé de compartiments distincts qui correspondent chacun à un portefeuille de titres présentant des objectifs d'investissement spécifiques. Au 31 janvier 2024, il comptait 39 compartiments, tous rattachés à un portefeuille distinct constitué de titres, de liquidités et d'autres instruments. Chaque compartiment peut offrir plusieurs types de catégories d'actions, qui peuvent se différencier selon leur montant de souscription minimum, leur montant de participation minimum, leur devise et/ou leurs critères d'éligibilité, leurs commissions et frais et leur politique en matière de dividendes. Le fonds peut être proposé à la vente dans les États membres de l'Espace économique européen (« EEE »), sous réserve d'une notification dans les autres pays que le Grand-Duché de Luxembourg, et dans certaines juridictions sous réserve de respecter les exigences locales concernant l'offre. Veuillez garder à l'esprit que tous les compartiments et toutes les catégories ne sont pas nécessairement enregistrés ou autorisés à la distribution dans toutes les juridictions. La liste des catégories d'actions offertes pour chaque compartiment au 31 janvier 2024 figure à la rubrique « Statistiques » du présent rapport.

Note 2 : Résumé des règles et méthodes comptables importantes

Les états financiers ont été établis conformément aux exigences légales et réglementaires luxembourgeoises relatives aux fonds d'investissement. Vous trouverez à la Note 16 un rapprochement de l'incidence sur le produit net des placements des compartiments concernés résultant des différences comptables entre les exigences légales et réglementaires luxembourgeoises relatives aux fonds d'investissement et les principes comptables généralement admis aux États-Unis (« GAAP »).

A) *Recours à des estimations* – La préparation des états financiers conformément aux principes comptables généralement admis au Luxembourg oblige la direction à recourir à des estimations et à des hypothèses qui ont un impact sur les montants déclarés de l'actif et du passif, ainsi que sur les montants déclarés des revenus et des charges durant la période comptable. Les résultats réels peuvent être différents de ces estimations.

B) *Valorisation des instruments financiers* – Les titres de capital sont généralement valorisés à leur dernier cours négocié ou cours de clôture officiel sur le marché ou la Bourse où ils sont principalement négociés, tel que communiqué par un service de cotation tiers. Les titres de participation pour lesquels aucune vente n'a été signalée au cours de cette journée sont généralement valorisés au dernier cours acheteur de la séance sur le marché ou la bourse où ces titres sont principalement négociés, tel que communiqué par un service de cotation tiers.

Les titres de créance et les prêts à taux flottant sont généralement valorisés à un cours acheteur évalué ou composite, tel que communiqué par un service de cotation tiers.

Les options négociées en bourse sont généralement valorisées à leur dernier cours négocié ou cours de clôture officiel sur la bourse où elles sont principalement négociées, tel que communiqué par un service de cotation tiers. Les options négociées en bourse pour lesquelles aucune vente n'a été signalée au cours de cette journée sont généralement valorisées au dernier cours acheteur de la séance sur la bourse où ces titres sont principalement négociés, tel que communiqué par un service de cotation tiers. Pour les options de vente, la position peut être évaluée au dernier cours vendeur de la séance si aucune transaction n'a été réalisée au cours de la journée. Les options non cotées sont généralement valorisées à un cours acheteur communiqué par un négociateur-courtier. Les options de change sont généralement valorisées au moyen de valorisations communiquées par un service de cotation tiers.

Les contrats à terme standardisés sont généralement valorisés à leur cours de liquidation le plus récemment publié sur la bourse où ils sont principalement négociés, tel que communiqué par un service de cotation tiers. Les contrats à terme standardisés pour lesquels il n'y a eu aucune transaction au cours de cette journée à l'égard d'une position particulière sont généralement valorisés au dernier cours acheteur sur la bourse où ils sont principalement négociés, tel que communiqué par un service de cotation tiers.

Les contrats de swap sont généralement valorisés en utilisant des valorisations communiquées par un service de cotation tiers qui, pour les swaps compensés, inclut une évaluation de toute transaction effectuée auprès des chambres de compensation.

Les contrats de change à terme sont généralement valorisés à la moyenne des cours acheteur et vendeur sur la période, interpolés à partir de taux communiqués par un service de cotation tiers pour des périodes proches.

Les instruments à court terme dont l'échéance à l'émission est de 60 jours ou moins peuvent être valorisés à leur coût amorti, qui se rapproche de la valeur de marché.

Les sociétés d'investissement à capital variable sont généralement valorisées à leur valeur nette d'inventaire par action hors commissions de rachats (le cas échéant).

Les titres et autres actifs qui sont généralement valorisés sur la base d'informations communiquées par un service de cotation tiers peuvent également être valorisés sur la base du cours acheteur d'un négociateur-courtier.

Les valeurs communiquées par des services de cotation tiers peuvent utiliser tant des données de transactions que des informations de marché, telles que le rendement, la qualité, le taux du coupon, l'échéance, le type d'émission, les caractéristiques de négociation et d'autres données de marché. Les valeurs des titres et autres actifs et passifs exprimés dans d'autres devises que la devise de référence sont converties dans la devise de référence du compartiment sur la base de taux de change communiqués par un tiers.

La Société de Gestion a délégué la responsabilité première de calculer ou de prendre les dispositions nécessaires pour calculer la valeur des placements des compartiments (y compris toute valorisation à la juste valeur) à Massachusetts Financial Services Company (« MFS »), le Gestionnaire Financier, conformément aux politiques et procédures de valorisation approuvées par le Conseil d'administration de la Société et sous la surveillance de celui-ci. Lorsqu'il applique les procédures et politiques de valorisation, le Gestionnaire Financier fournit régulièrement des instructions à l'Agent d'Administration Centrale, en l'occurrence State Street Bank International GmbH, succursale du Luxembourg ("State Street"). Si le Gestionnaire Financier conclut que des cours de marché fiables ne sont pas facilement disponibles, les placements sont valorisés à leur juste valeur, qu'il déterminera de bonne foi, conformément à ces procédures et sous la surveillance du Conseil d'administration.

Conformément aux politiques et aux procédures de valorisation applicables aux compartiments, les investissements peuvent être valorisés à la juste valeur si le Gestionnaire Financier conclut que la valeur d'un placement a été influencée de manière importante par des événements survenus après la clôture de la bourse ou du marché sur lesquels le placement est principalement négocié (tel qu'une bourse ou un marché étranger) et avant la détermination de la valeur nette d'inventaire du compartiment, ou après la suspension des transactions sur un titre spécifique dans le cas où les transactions ne reprennent pas avant la clôture de la bourse ou du marché sur lesquels le titre est principalement négocié. Les événements qui surviennent après la clôture des marchés (tels que les évolutions sur les marchés étrangers) et avant la détermination de la valeur d'inventaire du compartiment peuvent être réputés avoir un effet important sur la valeur des titres négociés sur ces marchés. En conséquence, les titres de participation non américains (« étrangers ») du compartiment peuvent souvent être valorisés à la juste valeur. Le Gestionnaire Financier peut s'appuyer sur les informations communiquées par des services de cotation tiers ou sur d'autres informations (telles que la corrélation avec les fluctuations des cours de titres similaires sur le même marché ou sur d'autres marchés, le type, le coût et les caractéristiques d'investissement du titre, ainsi que le type d'activité et la situation financière de l'émetteur et les données de négociations et autres données de marché) pour l'aider à déterminer s'il doit calculer l'investissement à la juste valeur et, le cas échéant, à quelle juste valeur il doit l'évaluer. La valeur d'un placement aux fins du calcul de la valeur d'inventaire du compartiment peut varier en fonction de la source d'information et de la méthode utilisées pour calculer cette valeur. Lorsque la valorisation à la juste valeur est utilisée, la valeur d'un placement utilisée pour établir la valeur d'inventaire du compartiment peut varier par rapport aux cours négociés ou publiés de ce même placement. Rien ne garantit que le compartiment pourra obtenir la juste valeur attribuée à un investissement s'il devait le céder au moment où sa valeur nette d'inventaire par action est calculée.

- C) *Dividendes et intérêts* – Les dividendes perçus en numéraire sont comptabilisés à la date de détachement du coupon. Certains dividendes se rattachant à des titres étrangers sont comptabilisés lorsque le compartiment est informé du dividende, dans le cas où une telle information est reçue après la date de détachement du coupon. Les produits d'intérêts sont comptabilisés selon la comptabilité d'engagement. Chaque compartiment cumule généralement les décotes sur titres de créance comme des ajustements aux produits d'intérêts. Les compartiments n'amortissent pas les primes sur les titres de créance. Les dividendes et intérêts perçus sous la forme de titres supplémentaires sont comptabilisés à la date de détachement du coupon à un montant correspondant à la valeur du titre à cette date. Les obligations de dette peuvent être classées comme non courantes ou soumises à un taux d'intérêt inférieur au coupon contractuel si le recouvrement de la totalité ou d'une partie des intérêts devient douteux. Les revenus d'intérêts pour ces obligations de dettes peuvent être encore réduits par la radiation des créances d'intérêts correspondantes lorsqu'elles sont jugées non recouvrables.

Les compartiments peuvent recevoir les produits issus du règlement de litiges. Tout produit reçu dans le cadre d'un litige portant sur des placements d'un portefeuille est comptabilisé dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net au poste « Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change » dans le cas où le titre a été cédé par le compartiment, ou au poste « Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les produits dérivés et les conversions de devises » dans le cas où le titre est toujours détenu par le compartiment. Tout autre produit provenant d'un litige non lié aux placements en portefeuille est comptabilisé au poste des plus-values nettes réalisées des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net.

- D) *Conversion des devises* – Les achats et cessions de placements étrangers, ainsi que les revenus et charges initialement exprimés en devises étrangères, sont convertis chaque jour ouvré dans la devise de référence de chaque compartiment, sur la base des taux de change en vigueur aux dates respectives de telles transactions ou, pour les créances et les engagements libellés en devises étrangères, à la date d'arrêt des états financiers. La devise de référence des compartiments Blended Research European Equity Fund, Continental European Equity Fund, Euro Credit Fund, European Core Equity Fund, European Research Fund, European Smaller Companies Fund et European Value Fund est l'euro. La devise de référence du U.K. Equity Fund est la livre sterling. À compter du 7 juin 2022, la devise de référence du Japan Equity Fund a été modifiée, passant de l'USD au JPY. La devise de référence de chacun des autres compartiments est le dollar US. Les plus-values et moins-values imputables aux taux de change sur les ventes de titres et aux fluctuations des taux de change sur les créances, les dettes, les revenus et les charges sont comptabilisées pour les besoins des états financiers comme des plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change. La part des plus-values et moins-values tant réalisées que non réalisées sur les placements qui résulte des fluctuations des taux de change n'est pas comptabilisée séparément.
- E) *Coût des titres vendus* – Pour déterminer le coût des titres vendus, chaque compartiment utilise la méthode du coût identifié.
- F) *Exigences en matière de garanties au titre des instruments dérivés* – Le risque de crédit des contreparties aux instruments dérivés est géré au moyen d'une évaluation formelle de la solvabilité de toutes les contreparties potentielles. S'agissant de certains instruments dérivés non compensés, mais non de tous, le compartiment concerné tente de réduire son exposition au risque de crédit lié aux contreparties en concluant un contrat-cadre de l'International Swaps and Derivatives Association (ISDA) sur une base bilatérale, au niveau du compartiment. Le contrat-cadre de l'ISDA permet à chaque partie au contrat de résilier toutes les opérations négociées au titre de ce contrat si la qualité de crédit de l'autre partie venait à se détériorer d'une manière qui aura été définie au préalable. En cas de défaut de la contrepartie ou de résiliation du contrat-cadre de l'ISDA, la partie non défaillante a le droit de dénouer toutes les opérations négociées au titre de ce contrat et de compenser les montants exigibles au titre de chaque contrat en un montant net payable par une partie à l'autre. Ce droit de dénouer et de compenser les paiements sur l'ensemble des opérations négociées au titre du contrat-cadre de l'ISDA pourrait entraîner une réduction du risque de crédit du compartiment à l'égard de cette contrepartie égale à tous montants payables par le compartiment au titre des opérations applicables, le cas échéant. Ces droits de compensation peuvent être suspendus ou limités en cas d'insolvabilité de la contrepartie. Cependant, en l'absence de défaut de la contrepartie ou de résiliation du contrat-cadre de l'ISDA, les actifs et passifs portés au bilan au titre de l'ensemble des opérations conclues entre le compartiment et la contrepartie concernée ne feront pas l'objet d'une compensation en vertu de ce contrat.

Les exigences en matière de garantie et de marges diffèrent suivant le type d'instrument dérivé. Les exigences en matière de marges sont établies par le courtier et la chambre de compensation dans le cas d'instruments dérivés compensés (c.-à-d. les contrats à terme standardisés, les swaps compensés et les options négociées en bourse). Les conditions des garanties sont négociées en fonction de chaque contrat en ce qui concerne les instruments dérivés non compensés (c.-à-d. les contrats de change à terme, les contrats de swap non compensés et les options non compensées). S'agissant des instruments dérivés négociés en vertu d'un contrat-cadre de l'ISDA comportant une annexe prévoyant des garanties, les exigences en matière de garantie prévoient une compensation sur l'ensemble des opérations négociées en vertu de ce contrat spécifique, et un montant unique est versé par une partie à l'autre en tant que garantie de ces obligations. Les liquidités qui ont été isolées ou remises pour couvrir les obligations du compartiment en matière de garanties ou de marges en application de contrats dérivés, le cas échéant, sont respectivement comptabilisées séparément au Bilan en tant que « Numéraire soumis à restrictions » pour les produits dérivés non compensés et/ou « Dépôts auprès des courtiers » pour les produits dérivés compensés. Les titres donnés en gage aux mêmes fins comme garantie ou comme marges sont indiqués, le cas échéant, dans les Tableaux des investissements. Les

compartiments peuvent être tenus d'effectuer des paiements d'intérêts sur les obligations en matière de marge ou de sûreté non couvertes vis-à-vis du courtier. Ces paiements sont comptabilisés dans les « Intérêts et charges assimilées » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Les garanties reçues consistent en des liquidités et/ou en des emprunts d'État de haute qualité et ne sont pas reportées dans les Bilans ou les Tableaux des investissements. Au 31 janvier 2024, les compartiments suivants avaient des liquidités isolées ou avaient reçu des liquidités et/ou des emprunts d'État de haute qualité à titre de garanties pour les instruments dérivés ouverts compensés et non compensés.

Compartiment	Liquidités isolées par le Compartiment (Numéraire soumis à restrictions)	Garanties reçues par le compartiment	Dépôts auprès des courtiers pour des contrats à terme standardisés	Dépôts auprès des courtiers pour des swaps
Diversified Income Fund	— \$	— \$	79 350 \$	— \$
Emerging Markets Debt Fund	99 000 \$	720 000 \$	5 663 750 \$	— \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	— \$	— \$	63 872 \$	225 773 \$
Euro Credit Fund	— €	296 104 €	611 200 €	178 900 €
European Research Fund	— €	222 078 €	— €	— €
European Value Fund	— €	805 034 €	— €	— €
Global Credit Fund	— \$	— \$	292 143 \$	102 300 \$
Global High Yield Fund	— \$	288 450 \$	9 399 \$	— \$
Global Opportunistic Bond Fund	260 000 \$	80 000 \$	1 066 483 \$	1 699 300 \$
Global Total Return Fund	250 000 \$	440 000 \$	683 792 \$	594 500 \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	— \$	— \$	110 637 \$	— \$
Limited Maturity Fund	— \$	— \$	381 600 \$	2 874 577 \$
Managed Wealth Fund	— \$	— \$	455 196 \$	— \$
Prudent Capital Fund	— \$	3 000 000 \$	— \$	— \$
Prudent Wealth Fund	— \$	4 540 000 \$	— \$	— \$
U.S. Corporate Bond Fund	— \$	— \$	478 038 \$	— \$
U.S. Government Bond Fund	— \$	— \$	1 657 426 \$	— \$
U.S. Total Return Bond Fund	— \$	— \$	1 823 650 \$	— \$

G) *Contrats de change à terme* – Chaque compartiment peut conclure des contrats de change à terme portant achat ou cession d'une devise étrangère particulière à un prix fixe, à une date ultérieure. La conclusion de tels contrats comporte des risques tels que l'éventuelle impossibilité pour les contreparties de respecter les conditions de leurs contrats et les fluctuations inattendues de la valeur du contrat. Certains compartiments peuvent conclure des contrats de change à terme à des fins de gestion efficace du portefeuille, de couverture ou d'investissement. À des fins de gestion efficace du portefeuille, un compartiment peut conclure des contrats portant livraison ou réception de devises étrangères qu'il recevra ou dont il aura besoin dans le cadre de ses activités d'investissement courantes. À des fins de couverture, un compartiment peut utiliser des contrats de manière à protéger les titres libellés en devises étrangères contre une baisse éventuelle de leur valeur en raison de fluctuations défavorables des taux de change. À des fins d'investissement, certains compartiments peuvent conclure des contrats dans le but de modifier l'exposition relative de leur portefeuille de titres à différentes devises afin de tirer parti de fluctuations anticipées des taux de change. Les contrats de change à terme sont ajustés en fonction du taux de change quotidien de la devise sous-jacente, et toute plus-value ou moins-value non réalisée est comptabilisée comme créance à recevoir ou engagement à payer sur contrats de change à terme jusqu'à la date de règlement du contrat. À la date de règlement du contrat, toute plus-value ou moins-value est comptabilisée aux Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net en tant que plus-values (moins-values) réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change. Les garanties sous forme de liquidités ou de titres sont détenues sur des comptes séparés auprès du dépositaire du compartiment dans le cadre de ces contrats. De plus amples informations sur les contrats de change à terme en cours figurent à la Note 10.

H) *Catégories d'Actions Couvertes* – Certains compartiments offrent des catégories dans le but de réduire les fluctuations de change et de rendement entre la catégorie d'actions couverte applicable non libellée dans la devise de référence (« Catégories d'Actions Couvertes » à l'exception des Catégories d'Actions Couvertes en BRL tel que mentionné ci-dessous) et la catégorie non couverte libellée dans la devise de référence du compartiment concerné. Brown Brothers Harriman Investor Services Limited (« BBH »), en tant que prestataire délégué de services de couverture du risque de change pour les Catégories d'Actions Couvertes, a réalisé des opérations de couverture pour ces Catégories d'Actions Couvertes. Les clauses et conditions applicables aux Catégories d'Actions Couvertes sont les mêmes que celles qui s'appliquent aux mêmes catégories d'actions offertes dans la devise de référence, la seule différence étant la couverture appliquée à la Catégorie d'Actions Couvertes par rapport à la devise de référence du compartiment concerné. BBH peut exécuter ces opérations de couverture en ayant recours à des techniques et instruments de couverture divers, y compris les contrats de change à terme, les contrats de swap de devises, les contrats de change à terme standardisés, les options d'achat vendues et les options de vente achetées. Les plus-/moins- values et charges découlant du processus de couverture sont supportées par les Catégories d'Actions Couvertes. Étant donné qu'il n'y a pas de séparation des engagements entre les catégories d'actions des compartiments, il existe un risque que, dans certaines circonstances, les opérations de couverture de change à l'égard d'une catégorie d'actions (par exemple une Catégorie d'Actions Couverte) génèrent un endettement susceptible d'affecter la valeur nette d'inventaire des autres catégories d'actions du même compartiment. Par exemple, si une transaction de couverture en devise concernant une Catégorie d'Actions Couverte devait entraîner des engagements que la Catégorie d'Actions Couverte n'est pas en mesure de couvrir en raison d'actifs insuffisants, les actifs relevant des autres catégories d'actions du compartiment pourraient être utilisés pour couvrir lesdits engagements. De plus, les exigences en matière de présentation de garantie, susceptibles de devenir plus astreignantes au vu de la récente évolution de la réglementation, pourraient contraindre le compartiment concerné à affecter des sommes plus importantes aux liquidités et instruments assimilés que celles que le Gestionnaire Financier aurait décidé d'allouer en temps normal. Cette situation pourrait nuire aux performances de l'ensemble du

compartiment, même si les opérations sur instruments dérivés correspondantes concernent uniquement les Catégories d'Actions Couvertes. De plus amples informations sur les contrats de change à terme spécifiques à certaines catégories en cours figurent à la Note 11.

Les Catégories d'Actions Couvertes en BRL visent à convertir systématiquement la valeur de l'actif net en réal brésilien (« BRL ») par le biais d'instruments dérivés. Les Catégories d'Actions Couvertes en BRL sont similaires en termes de caractéristiques et de risques aux autres Catégories d'Actions Couvertes telles que décrites ci-dessus, à l'exception du fait qu'elles ne sont pas libellées en BRL (en raison de restrictions de change sur le BRL), mais dans la devise de référence du Fonds concerné. Les Catégories d'Actions Couvertes en BRL sont désignées par un « R » (par exemple, IH1R (USD)). Les références à des « Catégories d'Actions Couvertes » dans le présent document incluent également les Catégories d'Actions Couvertes en BRL.

- I) *Options vendues* – En échange d'une prime, chaque compartiment peut vendre des options d'achat sur des titres pour lesquels il a anticipé une baisse des cours et vendre des options de vente sur des titres dont il a anticipé une hausse des cours. Au moment où il vend l'option concernée, le compartiment doit penser que la prime reçue dépassera la perte potentielle susceptible de résulter de fluctuations défavorables du cours du titre sous-jacent de cette option. Dans le cas d'une option vendue, le compartiment, en tant que vendeur de l'option, accorde à l'acheteur le droit d'acheter ou de vendre au compartiment un nombre spécifié d'actions ou de parts d'un titre, d'une devise ou d'un indice particulier à un prix spécifié, dans un délai spécifié. La prime est comptabilisée initialement au Bilan comme un passif. L'option est ultérieurement valorisée quotidiennement à la valeur de marché (marked-to-market), la différence entre la prime reçue et la valeur de marché de l'option vendue étant comptabilisée en tant que plus-value ou moins-value non réalisée. À l'expiration d'une option vendue, le compartiment réalise une plus-value égale au montant de la prime reçue. La différence entre la prime et le montant versé pour réaliser une opération de dénouement est considérée comme une plus-value ou une moins-value réalisée. Lorsqu'une option d'achat vendue est exercée, la prime est comparée au produit afin de déterminer la plus-/moins-value réalisée. Lorsqu'une option de vente vendue est exercée, la prime vient en déduction du prix de revient du titre acheté par le compartiment. Les garanties pour les options non compensées, sous forme de liquidités ou de titres, sont détenues sur des comptes séparés auprès du dépositaire du compartiment dans le cadre de ces contrats.

Lors de la conclusion d'un contrat d'option vendue, s'agissant d'options négociées en bourse, le compartiment est tenu de déposer des titres ou des espèces comme garantie soit auprès du dépositaire, soit pour le bénéfice du courtier ou directement auprès du courtier de compensation, selon le type d'option. S'agissant d'options non compensées, le compartiment peut déposer des garanties sous réserve des conditions d'un contrat-cadre de l'ISDA, comme décrit de manière générale ci-avant, si la valeur de marché du contrat d'option évolue en sa défaveur. Il se peut que le compartiment, en tant que vendeur d'une option, n'ait aucun contrôle sur la question de savoir si les titres sous-jacents peuvent être vendus (option d'achat) ou achetés (option de vente), et il supporte, par conséquent, le risque de marché d'une évolution défavorable du cours du titre sous-jacent de l'option vendue. Les pertes sur la vente d'options peuvent dépasser la prime reçue ainsi que la perte potentielle sur une transaction d'achat et de vente ordinaire. Bien que le risque de marché du compartiment puisse être substantiel, le risque de crédit de contrepartie maximal pour le compartiment est égal à la valeur de marché de toute garantie présentée au courtier. S'agissant des options non compensées, le risque est atténué lorsque le compartiment et la contrepartie ont conclu un contrat-cadre de l'ISDA prévoyant une compensation comme décrit ci-avant.

- J) *Options achetées* – Chaque compartiment peut acheter des options d'achat ou de vente en échange d'une prime. Les options d'achat ou de vente achetées donnent à leur titulaire le droit d'acheter ou de vendre un nombre spécifié d'actions ou de parts d'un titre, d'une devise ou d'un indice particuliers à un prix spécifié, à une date spécifiée ou dans un délai spécifié. L'achat d'options d'achat peut constituer une couverture contre une augmentation anticipée du coût des titres ou d'une devise dont l'acquisition est prévue ou peut augmenter l'exposition du compartiment à un instrument sous-jacent. L'achat d'options de vente peut constituer une couverture contre une baisse anticipée de la valeur des titres ou d'une devise détenus en portefeuille ou diminuer l'exposition du compartiment à un instrument sous-jacent. La prime versée est enregistrée initialement comme un placement dans les Tableaux des investissements. Ce placement est ultérieurement valorisé quotidiennement à la valeur de marché (marked-to-market), la différence entre la prime versée et la valeur de marché de l'option achetée étant comptabilisée en tant que plus-value ou moins-value non réalisée. Les primes versées au titre d'options d'achat ou de vente achetées ayant expiré sont comptabilisées aux Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net comme des moins-values nettes réalisées sur placements. Lors de l'exercice ou du dénouement d'une option achetée, la prime versée est soit ajoutée au coût du titre ou de l'instrument financier dans le cas d'une option d'achat, soit compensée par rapport au produit de la vente du titre ou de l'instrument financier sous-jacent dans le cas d'une option de vente, afin de déterminer la plus-value ou moins-value nette réalisée sur les placements, les instruments dérivés et les opérations de change. Que l'option soit exercée ou non, le risque de perte maximal pour le compartiment par rapport à l'achat d'une option correspond au montant de la prime payée. Tous les contrats d'option comportent un risque de crédit si la contrepartie au contrat ne remplit pas ses obligations. S'agissant des options non compensées, ce risque est atténué dans le cas où un contrat-cadre de l'ISDA prévoyant une compensation a été conclu entre le compartiment et la contrepartie, comme décrit ci-avant, et où, le cas échéant, la contrepartie constitue des garanties pour couvrir l'exposition du compartiment à celle-ci conformément au contrat-cadre de l'ISDA concerné.

- K) *Contrats de swap* – Certains compartiments peuvent conclure des contrats de swap. Un contrat de swap est généralement un échange de paiements en numéraire, à des intervalles spécifiés ou lors de la survenance d'événements spécifiés, entre le compartiment et une autre partie. Les swaps peuvent faire l'objet d'une compensation centralisée (« swaps compensés ») ou ne pas être compensés (« swaps non compensés »). Dans une transaction de swap compensé, la contrepartie ultime de la transaction est une chambre de compensation (la « chambre de compensation »). Le contrat est transféré et accepté par la chambre de compensation dès sa signature avec un courtier exécutant. Pendant toute la durée du swap compensé, le compartiment traite indirectement avec la chambre de compensation par l'intermédiaire d'un courtier de compensation et est également exposé au risque de contrepartie par rapport à ce dernier. Les paiements en numéraire nets sont échangés à des intervalles spécifiés, et les revenus ou les charges anticipés sont comptabilisés selon la comptabilité d'engagement. Le contrat de swap est comptabilisé à la valeur et ajusté quotidiennement, et le changement de valeur est comptabilisé aux Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net en tant que plus-value ou moins-value non réalisée. La valeur du contrat du swap, qui est ajustée quotidiennement, est comptabilisée au Bilan en tant que « Swaps, à leur valeur » pour les swaps non compensés. Pour les swaps compensés, le compartiment exécute ou reçoit chaque jour les versements (marge de variation) en fonction des fluctuations quotidiennes de la valeur du swap compensé, de sorte que seuls les montants nets à recevoir ou à payer découlant de la marge de variation du jour sont inclus dans les « Créances à recevoir des courtiers » ou « Engagements envers des courtiers », tels qu'ils sont comptabilisés au Bilan. Les montants versés ou reçus lors de la création du swap sont déclarés à la Note 14 en tant que primes reçues ou payées et sont amortis au moyen de la méthode des intérêts effectifs sur la durée du contrat. Un versement de liquidation reçu ou effectué lors de la résiliation est comptabilisé en tant que plus-value ou moins-value réalisée aux Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Dans la plupart des cas, les garanties pour les swaps non compensés, sous forme de liquidités ou de titres, sont détenues sur des comptes séparés auprès du dépositaire du compartiment dans le cadre de ces contrats. La garantie

peut également être envoyée directement à certaines contreparties. Les garanties pour les swaps compensés, sous forme de liquidités ou de titres, sont directement déposées par le compartiment auprès du courtier de compensation.

Les risques liés aux contrats de swap comprennent l'absence éventuelle d'un marché liquide, un marché défavorable, les fluctuations des taux d'intérêt de l'instrument sous-jacent et la non-exécution de ses obligations par la contrepartie en vertu des termes des contrats. Le risque de perte maximal du compartiment résultant du risque de solvabilité de la contrepartie est égal à la valeur nette des flux de trésorerie actualisés devant être reçus/versés à la contrepartie sur la durée restante du contrat, dans la mesure où ce montant est positif, plus toute garantie envoyée directement à la contrepartie. Afin de gérer le risque de contrepartie, les contrats de swap non compensés sont limités à des contreparties bénéficiant de notes de crédit élevées. Le risque est encore atténué par la conclusion entre le compartiment et sa contrepartie d'un contrat-cadre de l'ISDA prévoyant une compensation comme décrit ci-avant et, le cas échéant, la présentation d'une garantie au compartiment par la contrepartie afin de couvrir l'exposition du compartiment à la contrepartie en vertu de ce contrat-cadre. Le risque de contrepartie lié aux swaps compensés pour le compartiment est atténué par le fait que la chambre de compensation est la véritable contrepartie et par les dispositions réglementaires de protection applicables en cas de faillite d'une chambre ou d'un courtier de compensation. Certains compartiments peuvent conclure des swaps à des fins de gestion efficace du portefeuille. Certains compartiments peuvent également conclure des contrats de swap à des fins d'investissement. À des fins de gestion efficace du portefeuille, un compartiment peut conclure des contrats de swap pour réduire son exposition aux fluctuations des taux d'intérêt et des taux de change. À des fins d'investissement, certains compartiments peuvent recourir à des swaps pour établir des positions sur des variations anticipées de l'indice financier sous-jacent.

Swaps de taux d'intérêt – Les contrats de swap de taux d'intérêt impliquent l'échange périodique de flux de trésorerie, entre le compartiment et une contrepartie, sur la base des différences entre deux taux d'intérêt appliqués à un montant de principal notionnel. Les deux taux d'intérêt échangés peuvent être soit un taux fixe et un taux flottant, soit deux taux flottants basés sur des indices différents. Les montants nets à recevoir ou à payer associés à ces versements sont provisionnés quotidiennement et sont comptabilisés aux Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net comme des plus-values ou moins-values non réalisées, et tous les versements reçus ou effectués sont comptabilisés comme des plus-values ou moins-values réalisées. De plus amples informations sur les swaps de taux d'intérêt en cours figurent à la Note 14.

Swaps sur défaillance de crédit – Les swaps sur défaillance de crédit sont des contrats ayant pour objet de gérer l'exposition d'un compartiment au marché ou à certains secteurs du marché, de réduire le risque de crédit lié à son exposition aux défaillances d'émetteurs du secteur privé et d'émetteurs souverains ou de créer une exposition aux émetteurs du secteur privé ou aux émetteurs souverains auxquels il n'est pas autrement exposé. Dans un contrat de swap sur défaillance de crédit, l'acheteur de la protection peut effectuer un versement initial et verse au vendeur de la protection un flux de versements basés sur un pourcentage fixe appliqué au montant notionnel du contrat, en échange du droit de recevoir un rendement spécifié lors de la survenance d'un événement de crédit défini sur l'obligation de référence (laquelle peut être soit un titre unique, soit un panier de titres émis par des émetteurs du secteur privé ou des émetteurs souverains) et, s'agissant des cas où s'applique un règlement physique, la remise par l'acheteur au vendeur d'une obligation définie à remettre. Bien que spécifiques à un contrat, les événements de crédit correspondent généralement à une combinaison des facteurs suivants : faillite, défaut de paiement, restructuration, anticipation d'obligation, défaillance d'obligation ou répudiation/moratoire, chacun d'entre eux tel que défini dans les Définitions des Dérivés de Crédit de l'ISDA de 2003, telles que modifiées par le contrat concerné. La restructuration ne s'applique généralement pas lorsque l'obligation de référence est émise par une société nord-américaine, et l'anticipation d'une obligation, la défaillance d'une obligation ou la répudiation/le moratoire ne s'appliquent généralement que lorsque l'obligation de référence est émise par une entité souveraine ou une entité d'un pays émergent. Lors du calcul du cours final de l'obligation à remettre (ou lors de la remise de l'obligation à remettre en cas de règlement physique), la différence entre la valeur de l'obligation à remettre et le montant notionnel du swap est comptabilisée aux Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net en tant que plus-value ou moins-value réalisée. Comme indiqué ci-avant dans la présente note, les exigences en matière de garanties pour ces swaps, s'ils ne sont pas compensés, sont généralement basées sur la valeur de marché du swap compensée des exigences en matière de garanties pour les autres types d'instruments dérivés non compensés en application du contrat-cadre de l'ISDA avec chaque contrepartie. De plus amples informations sur les swaps sur défaillance de crédit en cours figurent à la Note 14.

- L) *Contrats à terme standardisés* – Les compartiments peuvent conclure des contrats à terme standardisés, qu'ils peuvent utiliser pour obtenir une large exposition au marché, une exposition aux taux d'intérêt ou une exposition de change, ou une couverture contre ces expositions, ou pour gérer la duration. Un contrat à terme standardisé représente un engagement d'acheter ou de vendre un actif à un prix spécifié et à une date spécifiée. Au moment de conclure un contrat à terme standardisé, un compartiment est tenu de déposer auprès du courtier, soit en numéraire, soit en titres, une marge initiale d'un montant égal à un certain pourcentage du montant notionnel du contrat, ce qui soumet le compartiment au risque de contrepartie vis-à-vis du courtier de compensation et éventuellement de la chambre de compensation au titre de ce dépôt de garantie. Le compartiment exécute ou reçoit chaque jour les versements ultérieurs (marge de variation), en fonction des fluctuations quotidiennes de la valeur du contrat, et les comptabilise aux fins de l'établissement des états financiers comme des plus-values ou des moins-values non réalisées jusqu'au dénouement ou jusqu'à l'expiration du contrat, auquel moment la plus-value ou la moins-value sur le contrat à terme standardisé est réalisée. Lorsqu'il conclut de tels contrats, le compartiment assume le risque de fluctuations imprévues des taux d'intérêt, des taux de change ou des cours des titres, auquel cas il est possible que le compartiment ne réalise pas les bénéfices anticipés des contrats à terme et qu'il réalise une perte. Les détails des contrats à terme standardisés en cours figurent à la Note 13.
- M) *Comptes combinés* – Les Bilans, Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net combinés sont présentés en euros au taux de change en vigueur au 31 janvier 2024. L'ajustement au titre de la conversion de devises concerne la reconversion des valeurs nettes d'inventaire de l'ouverture de la période comptable à ce taux de change. Les taux de change (USD/EUR) en vigueur au 31 janvier 2024 et au 31 janvier 2023 étaient respectivement de 0,925326 et de 0,919836. Les taux de change (GBP/EUR) en vigueur au 31 janvier 2024 et au 31 janvier 2023 étaient respectivement de 1,172666 et de 1,134019. Les taux de change (JPY/EUR) en vigueur au 31 janvier 2024 et au 31 janvier 2023 étaient respectivement de 0,006287 et de 0,007067. Dans le cadre de la conversion de la devise de référence du Japan Equity Fund du 7 juin 2022, la valeur nette d'inventaire d'ouverture a été convertie de l'USD au JPY au taux de change de 130,855000 à la date de conversion du 3 juin 2022, ce qui s'est soldé par un ajustement monétaire de 70 774 425 ¥.
- N) *Intérêts négatifs* – Chaque compartiment peut être amené à payer des intérêts (« intérêts négatifs ») sur les soldes. Ces paiements sont comptabilisés dans les « Intérêts et charges assimilées » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net.
- O) *Distributions* – Le revenu imputé aux actions de capitalisation (A1, C1, I1, N1, S1, P1, W1 et Z1, si elles sont offertes) de chaque compartiment sera inclus dans la quote-part de l'actif net correspondant à ces actions. Chaque compartiment distribue aux détenteurs d'actions de distribution (A2, A4, C2, I2, N2 et W2, si elles sont offertes) la quasi-totalité des revenus de placements nets imputables à ces actions. Pour les actions de distribution brute (I3,

si elles sont offertes), le dividende est calculé à la discrétion du Conseil d'administration en fonction du revenu total des placements attribuable à ces actions, les charges de la catégorie concernée étant déduites après ladite distribution. Pour de plus amples détails, veuillez consulter le prospectus du fonds.

P) *Accords de mise en pension* – Chaque compartiment peut conclure des accords de mise en pension, certains d'entre eux pouvant être substitués par novation auprès de la chambre de compensation, la Fixed Income Clearing Corporation (« FICC »). Chaque accord de mise en pension est comptabilisé au coût. Pour certains accords de mise en pension, les garanties présentées par la contrepartie peuvent être détenues par le dépositaire des compartiments ou son agent, alors que, pour d'autres, elles sont détenues par un agent tiers. Dans ce dernier cas, les compartiments sont exposés au risque de contrepartie supplémentaire au titre de ces garanties en raison de l'insolvabilité éventuelle de l'agent tiers. En application de la réglementation luxembourgeoise, le dépositaire des compartiments a établi des procédures de suivi des garanties détenues par cet agent tiers pour le compte des compartiments. Chaque compartiment suit quotidiennement la valeur des garanties afin de s'assurer que cette valeur, y compris les intérêts courus, est supérieure aux montants dus au compartiment au titre de chaque accord de mise en pension. En cas de défaillance, le règlement d'un accord de mise en pension est garanti par la FICC. Les revenus d'intérêts perçus au titre des placements d'un compartiment dans des accords de mise en pension sont portés au poste « Revenus sur accords de mise en pension » dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Les détails des accords de mise en pension en circulation, y compris les diverses contreparties et les montants des garanties se rapportant à ces accords, sont présentés à la Note 12. Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024, les compartiments suivants ont eu des frais de transaction pour les accords de mise en pension. Ces montants sont inclus dans le total des frais de transaction de la Note 15.

Compartiment	Frais de transaction
Asia Ex-Japan Fund	885 \$
Contrarian Value Fund	885 \$
Diversified Income Fund	885 \$
Emerging Markets Debt Fund	885 \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	860 \$
Emerging Markets Equity Fund	885 \$
Emerging Markets Equity Research Fund	805 \$
Global Concentrated Fund	855 \$
Global Credit Fund	890 \$
Global Equity Fund	860 \$
Global Equity Income Fund	890 \$
Global High Yield Fund	890 \$
Global Intrinsic Value Fund	880 \$
Global Listed Infrastructure Fund (c)	145 \$
Global New Discovery Fund	805 \$
Global Opportunistic Bond Fund	885 \$
Global Research Focused Fund	885 \$
Global Strategic Equity Fund	655 \$
Global Total Return Fund	885 \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	830 \$
Limited Maturity Fund	875 \$
Managed Wealth Fund	890 \$
Prudent Capital Fund	885 \$
Prudent Wealth Fund	890 \$
U.S. Concentrated Growth Fund	880 \$
U.S. Corporate Bond Fund	885 \$
U.S. Government Bond Fund	885 \$
U.S. Total Return Bond Fund	870 \$
U.S. Value Fund	880 \$

(c) Le compartiment a commencé ses activités le 13 septembre 2023.

(Q) *Titres de créance ajustés en fonction de l'inflation* – Certains compartiments peuvent investir en titres de créance ajustés en fonction de l'inflation émis par le Trésor américain. Certains compartiments peuvent également investir dans des titres de créance ajustés en fonction de l'inflation émis par d'autres organismes du gouvernement américain que le Trésor américain ou par d'autres émetteurs, tels que les sociétés américaines ou étrangères et les États étrangers. La valeur du principal de ces titres de créance est corrigée par référence aux évolutions de l'indice américain des prix à la consommation ou d'un autre indice général des prix ou des salaires. Ces titres de créance versent normalement un taux d'intérêt fixe, mais ce taux fixe est appliqué au principal ajusté en fonction de l'inflation. Le principal payé à l'échéance est en général égal au principal ajusté en fonction de l'inflation ou bien à la valeur nominale d'origine du titre, si cette dernière est plus élevée. D'autres types de titres ajustés en fonction de l'inflation peuvent requérir d'autres méthodes d'ajustement en fonction d'autres mesures de l'inflation.

Note 3 : Procédure de swing pricing

Les importantes transactions entrantes ou sortantes d'un compartiment peuvent créer une « dilution » de ses actifs car le cours auquel un investisseur achète ou vend des actions ne reflète pas forcément la totalité de la transaction et autres coûts connexes qui sont engagés lorsque le Gestionnaire Financier négocie des titres pour compenser les entrées et sorties de montants considérables. La Société a donc adopté des procédures permettant d'ajuster à la hausse ou à la baisse la valeur nette d'inventaire d'un compartiment (dénommées « swing pricing ») en vue de réduire l'impact de ces coûts pour les actionnaires existants de ce compartiment. Selon ces procédures, les ajustements sont effectués chaque fois que les souscriptions, échanges et rachats nets d'actions de toutes catégories dépassent, un jour ouvré donné, un certain pourcentage de l'actif du compartiment fixé en tant que de besoin par le Conseil d'administration de la Société ou par la Société de Gestion. En cas de montant élevé d'achats nets, la valeur nette d'inventaire par action est ajustée à la hausse et les acquéreurs d'actions du compartiment versent à cette date de valorisation un montant supplémentaire pour compenser les frais de transaction connexes. À l'inverse, la valeur nette d'inventaire par action sera ajustée à la baisse en cas de montant élevé de rachats nets. La valeur nette d'inventaire ajustée s'applique à tous les achats, échanges ou rachats d'actions de toutes les catégories ce jour de valorisation. Étant donné que les achats, rachats et échanges nets d'un compartiment varient d'un jour ouvré à l'autre, il n'est pas possible de prédire la fréquence à laquelle la valeur nette d'inventaire d'un compartiment sera ajustée. En raison de ces ajustements, la volatilité de la valeur nette d'inventaire d'un compartiment peut ne pas refléter entièrement la performance réelle des actifs sous-jacents du compartiment. La VNI par action publiée/négociée, et adaptée conformément aux prescriptions légales et réglementaires luxembourgeoises relatives à l'établissement et à la présentation des états financiers, est communiquée dans la rubrique Statistiques et peut inclure un ajustement au titre du « swing pricing ». Cet ajustement n'est pas pris en considération dans les Bilans et Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Au 31 janvier 2024, aucun compartiment n'a inclus un ajustement au titre du « swing pricing ». Un rapport d'activité historique sur le « swing pricing » est disponible sur meridian.mfs.com.

Un ajustement de la valeur nette d'inventaire d'un compartiment (le « facteur de swing ») n'excède généralement pas 2 % de la valeur nette d'inventaire du compartiment concerné à la date de valorisation concernée. Cependant, dans des circonstances exceptionnelles et en tant que de besoin, dans le meilleur intérêt des investisseurs, le Conseil d'administration peut décider d'utiliser un facteur de swing supérieur à 2 % pour un compartiment. Cette décision doit être notifiée à la CSSF, et les investisseurs seront informés par un avis publié dans un quotidien du Luxembourg et un autre quotidien à plus grand tirage, ainsi que sur meridian.mfs.com.

Note 4 : Titres prêtés

Goldman Sachs Agency Lending (« GSAL ») peut, en qualité d'agent de prêt, prêter les titres de certains compartiments à certains établissements agréés (les « Emprunteurs ») approuvés par le fonds. Les prêts sont garantis par des garanties constituées de titres de créance d'État de haute qualité dont le montant est au moins égal à la valeur de marché des titres prêtés, lesquels sont valorisés quotidiennement à la valeur de marché (marked-to-market) ; ces garanties, qui sont conservées par le dépositaire, peuvent être conservées par un dépositaire par délégation au sein du réseau de dépositaires par délégation du dépositaire. GSAL fournit audit compartiment une garantie contre la défaillance de l'Emprunteur, qui couvre le fait de ne pas remettre au compartiment les distributions applicables au titre des titres prêtés ou de ne pas lui rendre les titres prêtés en application du contrat de prêt. L'Emprunteur verse une commission sur les prêts garantis par des titres de créance d'État de haute qualité qui est répartie entre le compartiment et l'agent de prêt (celui-ci n'étant pas une partie liée au fonds, à la Société de Gestion, au Gestionnaire Financier ou au Dépositaire). En vertu du contrat de prêt de titres en vigueur, la Société s'engage à verser à l'agent payeur un certain pourcentage sur les revenus générés par les opérations de prêt de titres : 15 % pour les montants allant jusqu'à 4 millions d'USD et 12,5 % pour les montants dépassant ce plafond. Une commission nominale de gestion de compte et par transaction est également versée à la Société fiduciaire de compensation du Dépositaire dans le cadre de la gestion des garanties. Les produits et les charges découlant des prêts de titres sont comptabilisés séparément dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Les revenus de dividendes et d'intérêts tirés des titres prêtés sont comptabilisés de la même manière que les autres revenus de dividendes et d'intérêts comme indiqué dans la Note 2. La valeur de marché des titres prêtés et des garanties au 31 janvier 2024 pour les compartiments applicables s'établissait comme suit :

Compartiment	Valeur de marché des titres prêtés	Valeur de marché des garanties
European Smaller Companies Fund	1 196 290 €	1 324 864 €
European Value Fund	38 953 394 €	43 824 620 €
U.S. Value Fund	633 180 \$	736 434 \$

Note 5 : Opérations avec des parties liées

A) *Commission de la Société de Gestion* – Le Conseil d'administration du fonds a désigné MFS Investment Management Company (Lux) S.à r.l. conformément à un Contrat de Société de Gestion pour assurer la gestion du fonds comme prescrit par la réglementation luxembourgeoise. La Société de Gestion est responsable de la gestion financière et des fonctions d'administration, de distribution et de commercialisation du fonds. Elle a été autorisée par le fonds à déléguer certaines fonctions administratives, de distribution et de gestion financière à des sociétés apparentées ou à des prestataires de services tiers, fonctions qui resteront néanmoins sous sa surveillance et son contrôle. Elle a désigné MFS, une société apparentée, en tant que Gestionnaire Financier et Agent de Services Administratifs.

Chaque compartiment verse à la Société de Gestion une commission annuelle approuvée par le Conseil d'administration du fonds et destinée à couvrir les frais des prestations de services offerts par la Société de Gestion dans le cadre de son mandat, majorée d'une marge bénéficiaire cible. Ces frais comprennent les commissions versées aux personnes dirigeantes indépendantes et administrateurs de la Société de Gestion, les coûts juridiques, réglementaires et opérationnels de la Société de Gestion, ainsi que les commissions versées par la Société de Gestion aux tiers lui fournissant des prestations de services d'administration, de gestion des risques et de reporting, y compris les prestations de services de soutien administratif fournies par MFS. Le fonds rembourse également à la Société de Gestion les débours liés à ses prestations de services. La commission de la Société de Gestion est calculée quotidiennement et répartie de sorte que chaque compartiment paie une commission fixe de 20 000 USD (ou l'équivalent dans une autre devise) majorée d'une commission calculée en fonction de l'actif net moyen quotidien supérieur à 40 millions USD et allant jusqu'à 4 milliards USD maximum (ou l'équivalent dans une autre devise) pour chaque compartiment. La commission de la Société de Gestion supportée par chaque compartiment pour l'exercice clos le 31 janvier 2024 était équivalente aux pourcentages annuels effectifs suivants de la moyenne quotidienne de l'actif net de chaque compartiment :

Compartiment	% de la moyenne quotidienne de l'actif net
Asia Ex-Japan Fund	0,0497 %
Blended Research European Equity Fund	0,2280 %
Continental European Equity Fund	0,0445 %
Contrarian Value Fund	0,0359 %
Diversified Income Fund	0,0418 %
Emerging Markets Debt Fund	0,0338 %
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	0,0715 %
Emerging Markets Equity Fund	0,0417 %
Emerging Markets Equity Research Fund	0,7121 %
Euro Credit Fund	0,0408 %
European Core Equity Fund	0,0383 %
European Research Fund	0,0333 %
European Smaller Companies Fund	0,0359 %
European Value Fund	0,0330 %
Global Concentrated Fund	0,0346 %
Global Credit Fund	0,0414 %
Global Equity Fund	0,0337 %
Global Equity Income Fund	0,3852 %
Global High Yield Fund	0,0364 %
Global Intrinsic Value Fund	0,0406 %
Global Listed Infrastructure Fund (c)	0,9011 %
Global New Discovery Fund	0,3435 %
Global Opportunistic Bond Fund	0,0352 %
Global Research Focused Fund	0,0384 %
Global Strategic Equity Fund	0,7189 %
Global Total Return Fund	0,0339 %
Inflation-Adjusted Bond Fund	0,0370 %
Japan Equity Fund	0,5588 %
Limited Maturity Fund	0,0347 %
Managed Wealth Fund	0,1166 %
Prudent Capital Fund	0,0337 %
Prudent Wealth Fund	0,0336 %
U.K. Equity Fund	0,0894 %
U.S. Concentrated Growth Fund	0,0350 %
U.S. Corporate Bond Fund	0,0353 %
U.S. Government Bond Fund	0,0354 %
U.S. Growth Fund	0,0472 %
U.S. Total Return Bond Fund	0,0349 %
U.S. Value Fund	0,0338 %

(c) Le compartiment a commencé ses activités le 13 septembre 2023.

B) *Commission de gestion financière* – La Société de Gestion a conclu un contrat de gestion financière avec MFS au titre des services de gestion financière pour les compartiments. La commission de gestion financière est calculée quotidiennement et payée mensuellement aux taux annuels suivants au 31 janvier 2024, sur la base de la moyenne quotidienne de l'actif net de chaque catégorie d'actions, pour les compartiments ci-dessous :

Compartiment	Catégorie A	Catégorie C	Catégorie I	Catégorie IF(a)	Catégorie N	Catégorie S	Catégorie W
Asia Ex-Japan Fund	1,05 %	1,05 %	0,75 %	—	1,05 %	1,05 %	0,80 %
Blended Research European Equity Fund	0,60 %	0,60 %	0,45 %	0,30 %	0,60 %	—	0,50 %
Continental European Equity Fund	1,00 %	1,00 %	0,70 %	0,45 %	1,00 %	—	0,75 %
Contrarian Value Fund	1,00 %	1,00 %	0,70 %	—	1,00 %	—	0,75 % (e)
Diversified Income Fund	0,85 %	0,85 %	0,70 %	—	0,85 %	—	0,75 %
Emerging Markets Debt Fund	0,90 %	0,90 %	0,70 %	—	0,90 %	0,90 %	0,80 %
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	0,90 %	0,90 %	0,75 %	—	0,90 %	—	0,80 %
Emerging Markets Equity Fund	1,15 %	1,15 %	0,90 %	—	1,15 %	1,15 %	0,95 %
Emerging Markets Equity Research Fund	1,15 %	1,15 %	0,90 %	—	1,15 %	—	0,95 %
Euro Credit Fund	0,50 %	0,50 %	0,40 %	0,25 %	0,50 %	—	0,45 %
European Core Equity Fund	1,05 %	1,05 %	0,75 %	—	1,05 %	—	0,80 %
European Research Fund	1,05 %	1,05 %	0,75 % (f)	—	1,05 %	—	0,80 %
European Smaller Companies Fund	1,05 %	1,05 %	0,85 %	—	1,05 %	—	1,05 %
European Value Fund	1,05 %	—	0,85 %	—	1,05 %	—	1,05 %
Global Concentrated Fund	1,15 %	1,15 %	0,95 %	—	1,15 %	1,15 %	1,15 %
Global Credit Fund	0,55 %	0,55 %	0,45 %	0,30 %	0,55 %	—	0,50 %
Global Equity Fund	1,05 %	1,05 %	0,85 %	—	1,05 %	1,05 %	1,05 %
Global Equity Income Fund	0,70 %	0,70 %	0,55 %	0,35 %	0,70 %	—	0,60 %
Global High Yield Fund	0,75 %	0,75 %	0,55 %	—	0,75 %	0,75 %	0,60 %
Global Intrinsic Value Fund	1,00 %	1,00 %	0,70 %	—	1,00 %	—	0,75 %
Global Listed Infrastructure Fund (c)	1,00 %	1,00 %	0,70 %	0,45 %	1,00 %	—	0,75 %
Global New Discovery Fund	1,00 %	1,00 %	0,80 %	0,50 %	1,00 %	—	0,85 %
Global Opportunistic Bond Fund	0,55 %	0,55 %	0,45 %	—	0,55 %	—	0,50 %
Global Research Focused Fund	1,00 %	1,00 %	0,70 %	—	1,00 %	1,00 %	0,75 %
Global Strategic Equity Fund	1,00 %	1,00 %	0,70 %	0,45 %	1,00 %	—	0,75 %
Global Total Return Fund	1,05 %	1,05 %	0,75 %	—	1,05 %	1,05 %	1,05 %
Inflation-Adjusted Bond Fund	0,50 %	0,50 %	0,45 %	—	0,50 %	0,50 %	0,50 %
Japan Equity Fund	1,00 %	1,00 %	0,70 %	—	1,00 %	—	0,75 %
Limited Maturity Fund	0,60 %	0,60 %	0,45 %	—	0,60 %	0,60 %	0,50 %
Managed Wealth Fund	1,00 %	1,00 %	0,75 %	—	1,00 %	—	0,80 %
Prudent Capital Fund	1,05 %	1,05 %	0,75 %	—	1,05 %	1,05 %	0,80 %
Prudent Wealth Fund	1,15 %	1,15 %	0,95 %	—	1,15 %	—	1,15 %
U.K. Equity Fund	1,00 %	1,00 %	0,70 %	—	1,00 %	—	0,75 %
U.S. Concentrated Growth Fund	1,15 %	1,15 %	0,95 %	—	1,15 %	1,15 %	1,00 %
U.S. Corporate Bond Fund	0,60 %	0,60 %	0,45 %	—	0,60 %	—	0,50 %
U.S. Government Bond Fund	0,50 %	0,50 %	0,45 %	—	0,50 %	0,50 %	0,50 %
U.S. Growth Fund	1,00 %	1,00 %	0,70 %	—	1,00 %	—	0,75 %
U.S. Total Return Bond Fund	0,55 %	0,55 %	0,45 %	—	0,55 %	0,55 %	0,50 %
U.S. Value Fund	1,05 %	1,05 %	0,75 %	—	1,05 %	1,05 %	0,80 %

(a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.

(b) Le compartiment a commencé ses activités le 13 septembre 2023.

(e) WSH1 (EUR), WSH1 (CHF) et WS1 (USD) ont une commission de gestion financière de 0,60 %.

(f) ISB1 (EUR) a une commission de gestion financière de 0,37 %.

Des frais sont appliqués aux actions de la catégorie P au titre des services de gestion financière et de distribution, et sont réunis dans les frais de gestion annuels. Les frais de gestion annuels sont calculés quotidiennement et payés mensuellement aux taux annuels suivants au 31 janvier 2024, sur la base de la moyenne quotidienne de l'actif net de chaque catégorie d'actions, pour les compartiments ci-dessous :

Compartiment	Catégorie P
Blended Research European Equity Fund	1,35 %
Contrarian Value Fund	1,75 %(a)
Diversified Income Fund	1,35 %
Emerging Markets Debt Fund	1,40 %
Emerging Markets Equity Fund	1,90 %
European Research Fund	1,80 %
Global Concentrated Fund	1,90 %
Global Equity Fund	1,80 %
Global Intrinsic Value Fund	1,75 %
Global New Discovery Fund	1,75 %(a)
Global Opportunistic Bond Fund	1,05 %
Global Total Return Fund	1,70 %
Managed Wealth Fund	1,75 %
Prudent Capital Fund	1,80 %
U.S. Value Fund	1,80 %

(a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.

La commission de gestion financière pour les actions de la catégorie Z sera administrativement prélevée et payée directement par l'actionnaire à MFS à l'égard des prestations de services de gestion financière offertes par cette dernière au compartiment, le versement de cette commission n'étant pas facturé au compartiment ou effectué par celui-ci.

- C) *Commissions de distribution et de service* – La Société de Gestion est également chargée de la surveillance de la fonction de distribution et de commercialisation à l'égard du fonds. La totalité des commissions de distribution et de service est versée à la Société de Gestion ou à sa société apparentée. La Société de Gestion, ou ses sociétés apparentées, peut verser tout ou partie de ces commissions aux intermédiaires financiers. La Société de Gestion peut obtenir de certaines de ses sociétés apparentées (y compris MFS International Limited) des prestations de services de soutien à la distribution.

Le fonds a adopté un plan de distribution prévoyant que chaque compartiment verse à la Société de Gestion ou sa société apparentée des commissions de distribution et/ou de service annuelles payées mensuellement. Chaque compartiment verse une commission annuelle de distribution établie en pourcentage de la moyenne quotidienne de l'actif net des actions de catégorie A, de catégorie C et de catégorie N aux taux suivants :

Compartiment	Catégorie A	Catégorie C	Catégorie N
Asia Ex-Japan Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Blended Research European Equity Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Continental European Equity Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Contrarian Value Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Diversified Income Fund	0,50 %	1,00 %	1,00 %
Emerging Markets Debt Fund	0,50 %	1,00 %	1,00 %
Emerging Markets Equity Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Emerging Markets Equity Research Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Euro Credit Fund	0,50 %	1,00 %	1,25 %
European Core Equity Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
European Research Fund	0,75 %	1,00 %	1,00 %
European Smaller Companies Fund	0,75 %	1,00 %	1,00 %
European Value Fund	0,75 %	—	1,00 %
Global Concentrated Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Global Credit Fund	0,50 %	1,00 %	1,25 %
Global Equity Fund	0,75 %	1,00 %	1,00 %
Global Equity Income Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Global High Yield Fund	0,50 %	1,00 %	1,25 %
Global Intrinsic Value Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Global Listed Infrastructure Fund (c)	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Global New Discovery Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %

Compartiment – (suite)	Catégorie A	Catégorie C	Catégorie N
Global Opportunistic Bond Fund	0,50 %	1,00 %	1,00 %
Global Research Focused Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Global Strategic Equity Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Global Total Return Fund	0,65 %	1,00 %	1,00 %
Inflation-Adjusted Bond Fund	0,40 %	1,00 %	1,25 %
Japan Equity Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Limited Maturity Fund	0,40 %	1,00 %	1,00 %
Managed Wealth Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Prudent Capital Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
Prudent Wealth Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
U.K. Equity Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
U.S. Concentrated Growth Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
U.S. Corporate Bond Fund	0,50 %	1,00 %	1,00 %
U.S. Government Bond Fund	0,40 %	1,00 %	1,00 %
U.S. Growth Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %
U.S. Total Return Bond Fund	0,50 %	1,00 %	1,00 %
U.S. Value Fund	0,75 %	1,00 %	1,25 %

(c) Le compartiment a commencé ses activités le 13 septembre 2023.

En contrepartie des commissions de distribution, la Société de Gestion ou sa société apparentée prend en charge, pour le compte de ces compartiments, les frais liés à la commercialisation et à la distribution de leurs actions, y compris une commission versée aux intermédiaires ou aux établissements financiers.

La commission de service versée à la Société de Gestion ou à sa société apparentée est établie au taux annuel de 0,50 % de la moyenne quotidienne de l'actif net imputable aux actions de catégorie C de chaque compartiment.

Les actions de catégorie A sont soumises à une commission d'émission de 6,00 % maximum de la valeur nette d'inventaire de ces actions. En ce qui concerne chaque compartiment, certains achats importants d'actions de catégorie A peuvent être effectués sans payer de commissions d'émission. Les actions de catégorie N et de catégorie P sont soumises à une commission d'émission de 3,00 % maximum de la valeur nette d'inventaire de ces actions. Les actions de catégorie C sont soumises à une commission de rachat de 1,00 % maximum dans le cas où le rachat est effectué dans les douze mois suivant l'achat. Des commissions d'émission peuvent être versées à la Société de Gestion ou sa société apparentée (dont la totalité ou une partie peuvent être payés en tant que commission par la Société de Gestion ou sa société apparentée à l'intermédiaire financier concerné lors de la vente d'actions de catégorie A) ou directement déduites du montant de l'achat applicable par l'intermédiaire financier lors de l'achat des actions de catégorie A. Les commissions d'émission peuvent être versées à La Société de Gestion ou sa société apparentée reçoit l'ensemble des commissions de rachat, qui sont généralement destinées à récupérer les commissions de vente versées par la Société de Gestion ou sa société apparentée aux intermédiaires financiers lors de l'achat d'actions de la catégorie en question.

La Société de Gestion a accepté d'accorder une remise partielle sur la commission de service pour les actions de catégorie C et sur la commission de distribution pour les actions des catégories A, N et P à la catégorie d'actions imputable aux comptes pour lesquels il n'y a pas de courtier ou d'autre intermédiaire financier désigné, à l'exception des comptes imputables au capital d'amorçage de MFS ou de ses sociétés apparentées. Les réductions au titre de ces contrats sont comptabilisées au poste « Charges remboursées par les parties liées » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net.

- D) *Jetons de présence* – Le fonds ne rémunère pas directement ses Administrateurs qui sont des employés de la Société de Gestion, du Gestionnaire Financier ou de ses sociétés apparentées (en dehors des débours liés au fonds). À la date du présent rapport, tous les Administrateurs du fonds sont des employés de la Société de Gestion, de MFS Investment Management ou de ses sociétés apparentées, sauf Thomas Bogart et James R. Julian Jr., dont la rémunération versée par les compartiments en montants cumulés s'élevait à 100 000 USD bruts par an durant la période comptable. Thomas Bogart et James R. Julian Jr. ont également été remboursés de leurs débours. Ce remboursement a été effectué par les compartiments. Ces frais sont inclus au poste « Divers » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024, les compartiments ont payé des frais de 775 USD.
- E) *Contrat de plafonnement des charges* – Chaque compartiment a conclu un contrat temporaire sur le plafonnement des charges par lequel MFS s'est engagée par écrit à assumer certaines des « Autres charges » du compartiment, à l'exclusion des impôts et taxes (autres que la taxe d'abonnement au Luxembourg), de certains frais de remboursement d'impôts (y compris les frais de contingence) et des frais associés aux activités d'investissement du compartiment, tels que les charges d'intérêts, de telle sorte que lesdites charges ne dépassent pas les taux des actifs nets moyens quotidiens des catégories A, C, I, N, P, W et Z indiqués dans le tableau ci-après.

Les « Autres charges » comprennent, de manière générale, l'ensemble des charges directes d'un compartiment autres que les frais de gestion d'investissement, les commissions de distribution et les frais de service. Elles comprennent, entre autres, les commissions payées à la Société de gestion, au Dépositaire et à l'Agent de transfert, les frais juridiques et d'audit, les charges de couverture des catégories d'actions, certaines charges associées aux activités d'investissement du compartiment, y compris les intérêts, et les charges liées au fonctionnement et à l'administration centrale du compartiment à Luxembourg. Elles ne comprennent cependant pas les commissions de courtage, les coûts de transaction ou de conversion de devises et les frais payés à l'agent de prêt de titres.

Pour la catégorie S, chaque compartiment a conclu un contrat temporaire sur le plafonnement des charges selon lequel MFS s'est engagée par écrit à assumer certaines charges directes, à l'exclusion des impôts et taxes (autres que la taxe d'abonnement au Luxembourg), de certains frais de remboursement d'impôts (y compris les frais de contingence) et des charges associées avec les activités d'investissement du compartiment comme les intérêts, de telle sorte que le « Total des frais sur encours » ne dépasse pas les pourcentages de la moyenne quotidienne de l'actif net figurant dans le tableau ci-après.

Dans la mesure où le « Total des frais sur encours » (dans le cas de la catégorie S) ou les « Autres charges » (dans le cas des autres catégories) dépassent le pourcentage de plafonnement des charges, la différence est attribuable à certaines autres charges qui sont exclues du contrat sur le plafonnement des charges, comme les intérêts associés aux activités d'investissement du compartiment, les commissions de courtage et les frais de transaction, les frais de conversion de devises ou les commissions payées à l'agent de prêt de titres.

Concernant les catégories IS et WS, la Société de gestion se réserve le droit d'offrir une exonération partielle de la commission de gestion financière et/ou un accord de prise en charge des « Autres charges ». Les réductions au titre de ces contrats sont comptabilisées au poste « Charges remboursées par les parties liées » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net.

Compartiment	Catégorie A	Catégorie C	Catégorie I	Catégorie N	Catégorie P	Catégorie S	Catégorie W	Catégorie Z
Asia Ex-Japan Fund	0,20 %	0,20 %	0,15 %	0,20 %	—	1,00 %	0,20 %	—
Blended Research European Equity Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,25 %	0,25 %	—	0,20 %	—
Continental European Equity Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	—
Contrarian Value Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	—
Diversified Income Fund	0,25 %	0,25 %	0,05 %	0,25 %	0,25 %	—	0,10 %	—
Emerging Markets Debt Fund	0,15 %	0,15 %	0,05 %	0,15 %	0,15 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	—
Emerging Markets Equity Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	0,10 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %
Emerging Markets Equity Research Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	—
Euro Credit Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,20 %	—	—	0,15 %	—
European Core Equity Fund	0,20 %	0,20 %	0,10 %	0,25 %	—	—	0,20 %	—
European Research Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,25 %	0,25 %	—	0,20 %	0,15 %
European Smaller Companies Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 % (f)	0,25 %	—	—	0,20 %	—
European Value Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,25 %	—	—	0,20 %	0,15 %
Global Concentrated Fund	0,25 %	—	0,15 %	0,25 %	0,25 %	1,00 %	0,20 %	—
Global Credit Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,15 %	—	—	0,10 %	—
Global Equity Fund	0,15 %	0,15 %	0,05 %	0,25 %	0,25 %	1,00 %	0,20 %	—
Global Equity Income Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,25 %	—	—	0,20 %	—
Global High Yield Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,15 %	—	1,00 %	0,10 %	—
Global Intrinsic Value Fund	0,15 %	0,15 %	0,05 %	0,10 %	0,10 %	—	0,10 %	—
Global Listed Infrastructure Fund (c)	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	—
Global New Discovery Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	0,10 % (a)	—	0,10 %	—
Global Opportunistic Bond Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,15 %	0,15 %	—	0,15 %	0,10 %
Global Research Focused Fund	0,15 %	0,15 %	0,10 %	0,10 %	—	1,00 %	0,10 %	—
Global Strategic Equity Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	—
Global Total Return Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,25 %	0,25 %	1,00 %	0,20 %	—
Inflation-Adjusted Bond Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,08 %	—	1,00 %	0,08 %	—
Japan Equity Fund	0,08 %	0,08 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	—
Limited Maturity Fund	0,15 %	0,15 %	0,05 %	0,15 %	—	1,00 %	0,10 %	—
Managed Wealth Fund	0,10 %	0,10 %	0,15 %	0,10 %	0,10 %	—	0,20 %	—
Prudent Capital Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,25 %	0,25 %	1,00 %	0,20 %	0,15 %
Prudent Wealth Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,25 %	—	—	0,20 %	—
U.K. Equity Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	—
U.S. Concentrated Growth Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,25 %	—	1,00 %	0,15 %	—
U.S. Corporate Bond Fund	0,15 %	0,15 %	0,05 %	0,15 %	—	—	0,10 %	—
U.S. Government Bond Fund	0,08 %	0,08 %	0,05 %	0,08 %	—	1,00 %	0,08 %	—
U.S. Growth Fund	0,10 %	0,10 %	0,05 %	0,10 %	—	—	0,10 %	0,05 %
U.S. Total Return Bond Fund	0,15 %	0,15 %	0,05 %	0,15 %	—	1,00 %	0,10 %	—
U.S. Value Fund	0,25 %	0,25 %	0,15 %	0,25 %	0,25 %	1,00 %	0,20 %	—

- (a) Pour de plus amples informations, voir la Note 18.
- (c) Le compartiment a commencé ses activités le 13 septembre 2023.
- (e) WSH1 (EUR), WSH1 (CHF) et WS1 (USD) ont un autre taux plafond de dépenses de 0,05 %.
- (f) ISB1 (EUR) a un autre taux plafond de dépenses de 0,10 %.

Les réductions au titre de ces contrats sont comptabilisées au poste « Charges remboursées par les parties liées » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Ces contrats de plafonnement des charges sont en vigueur jusqu'au 31 janvier 2025, date à laquelle ils pourraient être prolongés ou non. Toutes les opérations conclues entre le fonds et MFS l'ont été dans le cadre normal de l'activité et à des conditions commerciales normales. Le fonds n'a pas conclu d'opérations par l'intermédiaire d'un courtier ayant des liens avec lui et n'a effectué aucune opération hors du cadre normal de l'activité ou dans des conditions commerciales exceptionnelles.

Note 6 : Commissions de dépositaire

Chaque compartiment verse à State Street Bank International GmbH (« State Street »), succursale du Luxembourg, le dépositaire du fonds à l'échelle mondiale (le « Dépositaire »), une commission basée sur la valeur nette d'inventaire mensuelle des avoirs en fin de mois des compartiments sur les marchés étrangers et sur une commission basée sur le volume des opérations de chaque compartiment. Le Dépositaire et la Société de Gestion ou MFS, pour le compte du fonds, détermineront le niveau de la commission en tant que de besoin sur la base des taux de marché applicables au Luxembourg. La commission est approuvée par le Conseil d'administration du fonds. Les décaissements et débours raisonnables engagés par le Dépositaire ou par d'autres banques et établissements financiers auxquels est confiée la conservation des actifs des compartiments sont en sus de la commission de Dépositaire. La Société de Gestion et le fonds ont également conclu des contrats avec State Street afin que celle-ci agisse en qualité de Teneur de Registre, d'Agent de Transfert, d'Agent Payeur au Luxembourg, d'Agent d'Administration Centrale et d'Agent de Comptabilité du fonds. Le fonds verse à State Street, pour ces prestations de services, des commissions à des taux commerciaux convenus entre les parties et lui rembourse les débours raisonnables. Les commissions versées à State Street pour ces prestations de services font partie des charges d'exploitation de chaque compartiment, lesquelles sont plafonnées par MFS comme décrit à la Note 5.

Note 7 : Partage de commissions

Le Gestionnaire Financier et ses sociétés apparentées (le « Groupe mondial MFS ») utilisent une plate-forme d'investissement mondiale fondée sur le principe d'une collaboration étroite entre les membres de son équipe d'investissement, qui partagent leurs éléments de recherche et idées d'investissement. Les professionnels de l'investissement du Groupe mondial MFS s'appuient sur leurs propres recherches internes pour prendre des décisions d'investissement, même s'ils utilisent des recherches externes fournies par des courtiers ou d'autres prestataires de recherche pour aider à développer des idées d'investissement. La recherche externe est également utilisée pour aider à appréhender le consensus, le sentiment ou la perception du marché et à identifier les inefficiences relatives plus rapidement et plus efficacement.

Le Groupe mondial MFS prend les décisions relatives à l'acquisition de recherches externes de façon distincte et séparée des décisions relatives à la sélection des courtiers qui exécutent des transactions pour les comptes clients. Le Groupe mondial MFS n'exécute une transaction avec un courtier qui fournit des recherches externes que lorsqu'il estime que ce courtier est en mesure d'offrir les meilleures conditions d'exécution pour la transaction considérée.

Toutefois, comme l'autorise l'article 28(e) de la Loi boursière américaine de 1934 intitulée Securities Exchange Act, telle que modifiée (l'« Article 28(e) »), qui régit le Gestionnaire Financier, le Groupe mondial MFS peut amener certains clients à payer à un courtier fournissant au Groupe mondial MFS des « services de courtage et de recherche » (tels que définis par l'Article 28(e)), au titre d'une opération sur valeurs mobilières, une commission d'un montant supérieur à celui que d'autres courtiers auraient prélevé pour cette opération, si le Groupe mondial MFS estime de bonne foi que cette commission plus élevée est raisonnable au regard de la valeur des services de courtage et de recherche fournis, dans le cadre des responsabilités globales du Groupe mondial MFS à l'égard de ses clients. Les services de courtage et de recherche reçus peuvent être utiles et opportuns pour le Groupe mondial MFS aux fins de servir les comptes qui ont généré les commissions ainsi que d'autres clients du Groupe mondial MFS. En ce sens, il est possible que les services de recherche et de courtage fournis par les courtiers qui ont exécuté des opérations sur valeurs mobilières pour un client ne soient pas utilisés par MFS dans leur intégralité en lien avec le client dont le compte a généré les commissions de courtage.

Le Groupe mondial MFS a décidé d'assumer les coûts des recherches externes pour tous les comptes qu'il conseille, soit en finançant ces recherches externes sur ses propres ressources, soit en remboursant aux clients, de sa propre initiative et sur ses propres ressources, les commissions excédentaires versées pour l'obtention de recherches externes. Pour les comptes soumis à une interdiction réglementaire relative au versement de commissions excédentaires au titre de l'obtention de recherches, y compris les comptes directement ou indirectement régis par la Directive concernant les marchés d'instruments financiers dans l'UE ou au Royaume-Uni (« Comptes MiFID II »), le Groupe mondial MFS financera les recherches externes sur ses propres ressources. Pour tous les autres comptes, le Groupe mondial MFS applique un accord de partage de commissions qui génère des « crédits » de commissions permettant l'acquisition de recherches externes à partir des commissions sur les opérations sur actions, comme l'autorise l'Article 28(e). Au titre de cet accord, le Groupe mondial MFS peut amener un client à payer des commissions d'un montant supérieur à ce que le courtier ou d'autres courtiers auraient pu facturer pour certaines transactions en reconnaissance des services de courtage et de recherche fournis par le courtier d'exécution. Le Groupe mondial MFS a décidé de rembourser aux clients, de sa propre initiative et sur ses propres ressources, un montant égal à tous les crédits de commission générés au titre de cet accord.

Les services de recherche obtenus par le Groupe mondial MFS par l'intermédiaire de crédits de commissions peuvent inclure : un accès aux directions d'entreprise ; des conférences sectorielles ; des missions de recherche sur le terrain pour visiter les directions d'entreprise et/ou les installations de fabrication, de production ou de distribution ; des informations statistiques ou de recherche, et d'autres informations factuelles et services tels que des rapports de recherche en investissement ; des analyses ; un petit nombre de réseaux d'experts ; des rapports ou bases de données contenant des analyses d'entreprise, fondamentales, techniques et politiques ; des informations relatives à l'ESG ; des stratégies de modélisation de portefeuille ; et des services de recherche économique comme des publications, des services de représentation graphique et des avis d'économistes se rapportant aux informations macro-économiques, ainsi que des informations analytiques d'investissement au sujet de sociétés particulières.

En utilisant les services de courtage et de recherche éligibles acquis au moyen de crédits de commissions, le Groupe mondial MFS évite les charges supplémentaires qui seraient encourues s'il tentait de produire des informations comparables par l'intermédiaire de son propre personnel ou s'il achetait ces services au moyen de ses propres ressources. En conséquence, le montant payé en premier lieu par les clients au titre des transactions relatives à leur compte peut être supérieur à celui qu'ils auraient payé si le Groupe mondial MFS les avait amenés à payer les taux applicables à la seule exécution.

Toutefois, dans la mesure où le Groupe mondial MFS a décidé de rembourser aux clients, de sa propre initiative et sur ses propres ressources, les crédits de commissions générés par le courtage client, il assume en définitive les dépenses supplémentaires qu'il encourrait s'il finançait les recherches externes sur ses propres ressources.

Si le Groupe mondial MFS assume le plus souvent les coûts des recherches externes, il n'effectue pas, en règle générale, de paiements ni de remboursements aux clients au titre de recherches qu'un courtier met normalement à la disposition de tous ses clients et que le Groupe mondial MFS considère en règle générale comme revêtant une valeur minimale, ni au titre de recherches externes effectuées par des courtiers d'exécution dans le cadre d'opérations sur titres à revenu fixe faisant l'objet de majorations, minorations, et d'autres frais plutôt que de commissions. Concernant les titres à revenu fixe, le Groupe mondial MFS considère que les courtiers qui exécutent des opérations sur titres à revenu fixe ne facturent pas de montants inférieurs au titre des majorations, minorations, équivalents de commissions ou autres frais lorsque les clients renoncent à leurs services de recherche. Par conséquent, le Groupe mondial MFS ne considère pas qu'il verse aux courtiers des montants plus élevés au titre des majorations, minorations, équivalents de commissions ou autres frais applicables aux opérations sur titres à revenu fixe qu'il ne le ferait s'il ne recevait aucune recherche de la part des courtiers. Toutefois, la MiFID II considère généralement la recherche comme une incitation et, par conséquent, le Groupe mondial MFS paie pour certaines catégories de recherche sur les titres à revenu fixe reçues par les sociétés apparentées concernées par le biais de ses propres ressources.

Note 8 : Fiscalité

Le fonds est soumis au droit luxembourgeois en ce qui concerne son statut fiscal. En application de la législation et de la réglementation actuellement en vigueur au Luxembourg, il doit s'acquitter d'une taxe d'abonnement prélevée sur son actif net, au taux annuel de 0,05 % pour la catégorie A, la catégorie C, la catégorie N, la catégorie P et la catégorie W et de 0,01 % pour la catégorie I, la catégorie S et la catégorie Z. La taxe d'abonnement est calculée et payable trimestriellement sur l'actif net à la clôture de chaque trimestre civil. Les produits d'intérêts et revenus de dividendes et les plus-values sur titres peuvent faire l'objet d'une retenue à la source non récupérable dans les pays d'origine.

Le fonds est inscrit à la taxe sur la valeur ajoutée (TVA) au Grand-Duché de Luxembourg et est tenu de comptabiliser la TVA en application de la réglementation en vigueur.

Considérations fiscales spécifiques au Royaume-Uni – La Société a reçu le statut de « fonds déclarant » pour certains compartiments et catégories d'actions pour l'exercice clos le 31 janvier 2024. Vous trouverez de plus amples informations sur www.mfs.com.

Note 9 : Ligne de crédit

Chaque compartiment et les autres fonds gérés par MFS participent à une ligne de crédit engagée et non garantie, sous réserve d'une sous-limite de 250 millions USD, fournie par un consortium bancaire en application d'un contrat de crédit. Des emprunts peuvent être effectués pour faire face à des besoins de financement provisoires. Les intérêts sont facturés à chaque compartiment, en fonction de ses emprunts, généralement à un taux égal au plus élevé 1) de Daily Simple SOFR (Secured Overnight Financing Rate) plus 0,10 %, 2) du taux effectif des fonds fédéraux américains, ou 3) de l'OBFR, majoré d'une marge convenue. Une commission d'engagement, basée sur la moyenne quotidienne de la partie non utilisée de la ligne de crédit engagée, est répartie entre les compartiments participants. La ligne de crédit expire le 13 mars 2025, sauf extension ou renouvellement. Par ailleurs, chaque compartiment et les autres fonds gérés par MFS ont établi un accord d'emprunt non engagé et non garanti de 200 millions USD avec le Dépositaire pour les besoins de financement provisoires. Les intérêts sont facturés à chaque compartiment participant, en fonction de ses emprunts, à des taux égaux aux taux de référence habituels majorés d'une marge convenue. Tous les frais d'intérêts sont comptabilisés en tant qu'« intérêts et charges assimilées » et toutes les commissions sont comptabilisées au poste « Divers » des Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Aucun des compartiments n'avait d'emprunts en cours au titre de ces accords au 31 janvier 2024.

Note 10 : Contrats de change à terme ouverts

Au 31 janvier 2024, les compartiments étaient liés par les contrats de change à terme ouverts suivants. Chaque compartiment avait en caisse suffisamment de liquidités et/ou d'autres titres pour faire face à tous les engagements existant au titre de ces contrats dérivés.

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Diversified Income Fund							
Plus-value							
ACHAT	BRL	Goldman Sachs International	269 288	02/02/2024 - 03/05/2024	53 816 \$	54 003 \$	187 \$
VENTE	BRL	Barclays Bank PLC	1 906 460	02/02/2024 - 03/05/2024	384 225	383 026	1 199
VENTE	BRL	Goldman Sachs International	134 449	02/02/2024	27 256	27 138	118
VENTE	BRL	JPMorgan Chase Bank N.A.	1 003 778	02/02/2024	203 665	202 603	1 062
VENTE	CNH	UBS AG	9 000	19/04/2024	1 263	1 258	5
VENTE	CZK	BNP Paribas S.A.	1 657 515	19/04/2024	73 528	72 033	1 495
VENTE	CZK	Brown Brothers Harriman	66 481	19/04/2024	2 915	2 889	26
VENTE	CZK	Merrill Lynch International	2 025 852	19/04/2024	89 884	88 040	1 844
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	987 453	19/04/2024	1 078 353	1 070 646	7 707
VENTE	HUF	Deutsche Bank AG	5 662 827	19/04/2024	16 240	15 837	403
VENTE	MXN	Brown Brothers Harriman	180 028	19/04/2024	10 344	10 326	18
VENTE	MXN	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	189 607	19/04/2024	10 995	10 877	118
ACHAT	PEN	Merrill Lynch International	561 653	29/02/2024	147 280	147 525	245

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/ réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Diversified Income Fund – (suite)							
Plus-value – (suite)							
VENTE	PEN	JPMorgan Chase Bank N.A.	35 393	29/02/2024	9 405 \$	9 296 \$	109 \$
VENTE	PHP	Barclays Bank PLC	84 000	072/02/2024	1 506	1 492	14
Total							14 550 \$
Moins-value							
ACHAT	BRL	Barclays Bank PLC	970 011	02/02/2024	196 952 \$	195 788 \$	(1 164) \$
ACHAT	BRL	Goldman Sachs International	50 342	02/02/2024	10 163	10 161	(2)
ACHAT	BRL	JPMorgan Chase Bank N.A.	1 003 778	02/02/2024	202 640	202 603	(37)
VENTE	GBP	BNP Paribas S.A.	3 167	19/04/2024	4 006	4 015	(9)
ACHAT	HUF	BNP Paribas S.A.	15 543 254	19/04/2024	44 585	43 468	(1 117)
ACHAT	JPY	HSBC Bank	6 955 130	19/04/2024	47 924	47 830	(94)
VENTE	KRW	JPMorgan Chase Bank N.A.	38 946 000	26/04/2024	29 286	29 318	(32)
VENTE	MXN	Barclays Bank PLC	1 883 537	19/04/2024	107 887	108 048	(161)
VENTE	PEN	Barclays Bank PLC	526 260	29/02/2024	135 447	138 229	(2 782)
ACHAT	PLN	HSBC Bank	61 923	19/04/2024	15 578	15 449	(129)
ACHAT	PLN	Merrill Lynch International	75 683	19/04/2024	19 045	18 882	(163)
VENTE	PLN	HSBC Bank	45 789	19/04/2024	11 378	11 424	(46)
Total							(5 736) \$
Emerging Markets Debt Fund							
Plus-value							
ACHAT	BRL	Goldman Sachs International	9 507 354	03/05/2024	1 892 674 \$	1 900 941 \$	8 267 \$
VENTE	BRL	Barclays Bank PLC	188 787 288	02/02/2024 - 03/05/2024	38 068 261	37 929 759	138 502
VENTE	BRL	Citibank N.A.	72 122 737	02/02/2024	14 623 421	14 557 310	66 111
VENTE	BRL	Deutsche Bank AG	1 039 000	02/02/2024	209 751	209 713	38
VENTE	BRL	Goldman Sachs International	35 754 497	22/02/2024 - 03/05/2024	7 231 608	7 186 779	44 829
VENTE	BRL	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	19 319 407	02/02/2024	3 925 370	3 899 444	25 926
ACHAT	CAD	UBS AG	16 714	19/04/2024	12 404	12 444	40
VENTE	CLP	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	4 365 542 676	12/04/2024	4 729 732	4 672 895	56 837
VENTE	CNH	UBS AG	273 000	19/04/2024	38 311	38 164	147
VENTE	CZK	BNP Paribas S.A.	167 021 167	19/04/2024	7 409 126	7 258 444	150 682
VENTE	CZK	Merrill Lynch International	204 136 982	19/04/2024	9 057 257	8 871 431	185 826
VENTE	EUR	Merrill Lynch International	102 406 180	19/04/2024	111 796 827	111 033 897	762 930
VENTE	EUR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	3 137 655	19/04/2024	3 423 344	3 402 001	21 343
VENTE	HUF	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	927 039 029	19/04/2024	2 616 283	2 592 548	23 735
ACHAT	PEN	Merrill Lynch International	28 817 277	29/02/2024 - 29/04/2024	7 554 279	7 567 083	12 804
VENTE	PEN	Citibank N.A.	16 407 751	29/04/2024	4 353 921	4 305 637	48 284
VENTE	PEN	Goldman Sachs International	1 081 000	29/02/2024	290 251	283 938	6 313
VENTE	PEN	Merrill Lynch International	19 334 672	29/04/2024	5 165 693	5 073 705	91 988
VENTE	PLN	Merrill Lynch International	20 435 375	19/04/2024	5 147 320	5 098 430	48 890
Total							1 693 492 \$
Moins-value							
ACHAT	BRL	Barclays Bank PLC	96 405 145	02/02/2024	19 579 476 \$	19 458 489 \$	(120 987) \$
ACHAT	BRL	Citibank N.A.	72 122 737	02/02/2024	14 560 796	14 557 310	(3 486)
ACHAT	BRL	Deutsche Bank AG	1 039 000	02/02/2024	209 729	209 713	(16)
ACHAT	BRL	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	19 319 407	02/02/2024	3 900 153	3 899 444	(709)
ACHAT	CLP	Barclays Bank PLC	4 365 542 676	12/04/2024	4 704 046	4 672 895	(31 151)
VENTE	CZK	JPMorgan Chase Bank N.A.	19 127 438	19/04/2024	831 068	831 245	(177)

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/ réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Emerging Markets Debt Fund – (suite)							
Moins-value – (suite)							
ACHAT	EUR	Barclays Bank PLC	547 564	19/04/2024	598 315 \$	593 697 \$	(4 618) \$
ACHAT	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	5 304 390	19/04/2024	5 826 974	5 751 285	(75 689)
ACHAT	EUR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	3 600 240	19/04/2024	3 932 006	3 903 560	(28 446)
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	1 294 818	19/04/2024	1 424 036	1 403 906	(20 130)
ACHAT	HUF	BNP Paribas S.A.	2 522 771 454	19/04/2024	7 236 471	7 055 157	(181 314)
VENTE	KRW	Merrill Lynch International	7 347 260 000	26/04/2024	5 528 953	5 530 909	(1 956)
VENTE	MXN	Barclays Bank PLC	160 802 186	19/04/2024	9 210 591	9 224 362	(13 771)
VENTE	MXN	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	31 104 982	19/04/2024	1 766 823	1 784 327	(17 504)
ACHAT	PEN	Citibank N.A.	27 122 000	29/04/2024	7 157 765	7 117 215	(40 550)
VENTE	PEN	Merrill Lynch International	19 115 854	29/02/2024	4 920 299	5 021 018	(100 719)
ACHAT	PLN	HSBC Bank	15 298 538	19/04/2024	3 848 649	3 816 839	(31 810)
ACHAT	PLN	Merrill Lynch International	18 698 213	19/04/2024	4 705 255	4 665 025	(40 230)
Total							(713 263) \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund							
Plus-value							
VENTE	AUD	HSBC Bank	860 925	19/04/2024	579 075 \$	566 205 \$	12 870 \$
VENTE	BRL	Barclays Bank PLC	3 190 421	02/02/2024 - 03/05/2024	643 577	641 624	1 953
VENTE	BRL	Citibank N.A.	1 246 275	02/02/2024	252 702	251 549	1 153
VENTE	BRL	Goldman Sachs International	1 021 981	22/02/2024 - 03/05/2024	206 522	205 342	1 180
VENTE	CAD	HSBC Bank	3 976	19/04/2024	2 979	2 960	19
VENTE	CLP	Barclays Bank PLC	518 262 625	12/04/2024	559 480	554 751	4 729
VENTE	CLP	Citibank N.A.	38 621 883	12/04/2024	41 672	41 341	331
VENTE	CLP	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	24 261 732	12/04/2024	26 540	25 970	570
VENTE	CNH	HSBC Bank	163 415	19/04/2024	22 893	22 845	48
ACHAT	COP	Barclays Bank PLC	110 521 404	17/04/2024	27 480	27 987	507
ACHAT	COP	JPMorgan Chase Bank N.A.	147 029 767	17/04/2024	36 771	37 232	461
VENTE	EUR	HSBC Bank	104 233	19/04/2024	113 944	113 015	929
VENTE	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	10 964	19/04/2024	11 979	11 888	91
VENTE	HUF	BNP Paribas S.A.	76 307 403	19/04/2024	219 133	213 401	5 732
VENTE	IDR	Barclays Bank PLC	1 137 496 870	12/02/2024	73 074	72 074	1 000
VENTE	IDR	Goldman Sachs International	1 143 398 000	12/02/2024	73 502	72 448	1 054
VENTE	IDR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	441 800 067	12/02/2024	28 498	27 994	504
VENTE	JPY	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	10 537 924	19/04/2024	72 704	72 469	235
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	523 617 629	16/02/2024	405 783	392 630	13 153
VENTE	KRW	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	43 024 346	16/02/2024	33 352	32 262	1 090
VENTE	MYR	Barclays Bank PLC	736 821	14/03/2024 - 18/03/2024	158 093	156 190	1 903
ACHAT	PEN	Merrill Lynch International	97 592	29/02/2024	25 527	25 634	107
VENTE	PEN	Merrill Lynch International	155 000	29/02/2024	41 070	40 713	357
VENTE	PHP	Barclays Bank PLC	8 215 183	07/02/2024	147 276	145 914	1 362
VENTE	PLN	Merrill Lynch International	575 105	19/04/2024	145 268	143 483	1 785
VENTE	RON	UBS AG	497 935	19/04/2024	109 774	108 053	1 721
VENTE	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	722 000	03/04/2024	20 686	20 344	342
ACHAT	TRY	BNP Paribas S.A.	14 499 420	19/04/2024	435 642	442 151	6 509
ACHAT	ZAR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	536 866	19/04/2024	28 482	28 489	7
ACHAT	ZAR	State Street Bank Corp.	2 799 150	19/04/2024	148 521	148 536	15
Total							61 717 \$

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/ réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Emerging Markets Debt Local Currency Fund – (suite)							
Moins-value							
ACHAT	BRL	Barclays Bank PLC	1 960 137	02/02/2024	397 896 \$	395 636 \$	(2 260) \$
ACHAT	BRL	Citibank N.A.	1 750 635	02/02/2024	353 413	353 350	(63)
VENTE	BRL	Citibank N.A.	504 361	02/02/2024	101 625	101 801	(176)
VENTE	CAD	State Street Bank Corp.	947 958	19/04/2024	703 457	705 805	(2 348)
ACHAT	CNH	State Street Bank Corp.	4 156 204	19/04/2024	583 178	581 021	(2 157)
VENTE	COP	Barclays Bank PLC	796 947 144	17/04/2024	198 036	201 809	(3 773)
VENTE	COP	Goldman Sachs International	3 448 224 643	17/04/2024	857 661	873 186	(15 525)
ACHAT	CZK	Brown Brothers Harriman	643 457	19/04/2024	28 452	27 964	(488)
ACHAT	CZK	HSBC Bank	7 623 766	19/04/2024	337 425	331 315	(6 110)
ACHAT	EUR	Merrill Lynch International	132 552	19/04/2024	145 991	143 719	(2 272)
ACHAT	HUF	HSBC Bank	11 168 515	19/04/2024	31 391	31 234	(157)
ACHAT	IDR	Barclays Bank PLC	8 354 775 523	12/02/2024	537 880	529 378	(8 502)
ACHAT	IDR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	1 502 565 810	12/02/2024	96 333	95 206	(1 127)
ACHAT	JPY	HSBC Bank	61 288 806	19/04/2024	422 307	421 478	(829)
VENTE	JPY	Citibank N.A.	19 250 139	19/04/2024	131 617	132 382	(765)
ACHAT	MXN	HSBC Bank	108 447	19/04/2024	6 234	6 221	(13)
ACHAT	MXN	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	487 521	19/04/2024	28 266	27 966	(300)
VENTE	MXN	Barclays Bank PLC	2 656 896	19/04/2024	152 184	152 412	(228)
ACHAT	MYR	Barclays Bank PLC	8 591 112	14/03/2024 - 18/03/2024	1 836 039	1 820 817	(15 222)
ACHAT	PEN	Barclays Bank PLC	1 261 000	29/02/2024	337 705	331 218	(6 487)
ACHAT	PEN	Citibank N.A.	162 527	29/02/2024 - 29/04/2024	43 554	42 676	(878)
ACHAT	PEN	Merrill Lynch International	515 000	29/02/2024	138 385	135 271	(3 114)
VENTE	PEN	Citibank N.A.	121 232	29/04/2024	31 812	31 813	(1)
VENTE	PEN	Merrill Lynch International	2 121 631	29/02/2024	546 094	557 273	(11 179)
ACHAT	PLN	HSBC Bank	3 265 957	19/04/2024	821 435	814 824	(6 611)
ACHAT	PLN	Merrill Lynch International	3 698 735	19/04/2024	930 757	922 799	(7 958)
ACHAT	RON	HSBC Bank	164 587	19/04/2024	35 910	35 716	(194)
ACHAT	SGD	State Street Bank Corp.	189 903	19/04/2024	142 102	142 042	(60)
ACHAT	THB	Barclays Bank PLC	20 697 470	03/04/2024	596 400	583 203	(13 197)
ACHAT	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	46 191 598	03/04/2024	1 330 205	1 301 563	(28 642)
VENTE	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	10 071 338	03/04/2024	283 243	283 785	(542)
VENTE	TRY	State Street Bank Corp.	2 481 111	19/04/2024	74 714	75 660	(946)
Total							(142 124) \$
Euro Credit Fund							
Plus-value							
ACHAT	GBP	BNP Paribas S.A.	257 285	19/04/2024	300 278 €	300 890 €	612 €
ACHAT	USD	BNP Paribas S.A.	435 961	19/04/2024	400 760	402 085	1 325
Total							1 937 €
Moins-value							
VENTE	GBP	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	871 163	19/04/2024	1 013 835 €	1 018 809 €	(4 974) €
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	8 825 890	19/04/2024	10 235 547	10 321 719	(86 172)
VENTE	GBP	UBS AG	342 361	19/04/2024	397 913	400 385	(2 472)
VENTE	USD	State Street Bank Corp.	15 033 803	19/04/2024	13 785 639	13 865 619	(79 980)
Total							(173 598) €

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/ réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Credit Fund							
Plus-value							
ACHAT	CAD	UBS AG	1 207 727	19/04/2024	896 286 \$	899 216 \$	2 930 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	239 477	19/04/2024	260 309	259 653	656
VENTE	EUR	Citibank N.A.	375 410	19/04/2024	409 559	407 038	2 521
VENTE	EUR	HSBC Bank	7 032 643	19/04/2024	7 688 846	7 625 143	63 703
VENTE	EUR	NatWest Markets PLC	298 745	19/04/2024	325 927	323 914	2 013
VENTE	EUR	UBS AG	308 813	19/04/2024	337 154	334 831	2 323
VENTE	GBP	HSBC Bank	415 812	19/04/2024	527 595	527 255	340
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	98 896	19/04/2024	126 107	125 401	706
VENTE	GBP	UBS AG	275 578	19/04/2024	349 980	349 436	544
Total							75 736 \$
Moins-value							
ACHAT	AUD	UBS AG	1 232 739	19/04/2024	829 681 \$	810 737 \$	(18 944) \$
ACHAT	CAD	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	166 933	19/04/2024	124 715	124 290	(425)
ACHAT	CHF	UBS AG	323 295	19/04/2024	384 018	377 760	(6 258)
ACHAT	EUR	Barclays Bank PLC	87 670	19/04/2024	95 414	95 056	(358)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	344 789	19/04/2024	375 094	373 838	(1 256)
ACHAT	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	1 529 264	19/04/2024	1 681 527	1 658 105	(23 422)
ACHAT	EUR	Merrill Lynch International	754 466	19/04/2024	823 791	818 030	(5 761)
ACHAT	EUR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	31 948	19/04/2024	34 708	34 640	(68)
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	1 429 354	19/04/2024	1 558 010	1 549 778	(8 232)
ACHAT	GBP	JPMorgan Chase Bank N.A.	373 178	19/04/2024	474 751	473 194	(1 557)
ACHAT	GBP	UBS AG	228 565	19/04/2024	291 484	289 823	(1 661)
VENTE	GBP	BNP Paribas S.A.	821 530	19/04/2024	1 039 347	1 041 710	(2 363)
ACHAT	JPY	HSBC Bank	112 969 926	19/04/2024	778 412	776 885	(1 527)
VENTE	JPY	JPMorgan Chase Bank N.A.	29 650 423	19/04/2024	203 262	203 904	(642)
ACHAT	NOK	State Street Bank Corp.	374 256	19/04/2024	36 036	35 647	(389)
ACHAT	NZD	State Street Bank Corp.	119 890	19/04/2024	73 831	73 286	(545)
ACHAT	SEK	State Street Bank Corp.	281 782	19/04/2024	27 545	27 158	(387)
Total							(73 795) \$
Global High Yield Fund							
Plus-value							
VENTE	EUR	HSBC Bank	438 000	19/04/2024	476 006 \$	474 901 \$	1 105 \$
VENTE	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	44 866 208	19/04/2024	49 019 593	48 646 184	373 409
VENTE	EUR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	150 000	19/04/2024	163 910	162 638	1 272
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	774 606	19/04/2024	850 255	839 867	10 388
VENTE	EUR	UBS AG	317 722	19/04/2024	346 135	344 490	1 645
ACHAT	GBP	State Street Bank Corp.	99 001	19/04/2024	125 412	125 535	123
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	289 778	19/04/2024	369 562	367 442	2 120
Total							390 062 \$
Moins-value							
ACHAT	EUR	HSBC Bank	391 216	19/04/2024	427 422 \$	424 176 \$	(3 246) \$
ACHAT	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	122 272	19/04/2024	133 209	132 573	(636)
ACHAT	EUR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	300 186	19/04/2024	326 116	325 477	(639)
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	1 538 174	19/04/2024	1 675 572	1 667 766	(7 806)
ACHAT	EUR	UBS AG	481 003	19/04/2024	524 263	521 527	(2 736)

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/ réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global High Yield Fund – (suite)							
Moins-value – (suite)							
ACHAT	GBP	JPMorgan Chase Bank N.A.	193 881	19/04/2024	246 001 \$	245 843 \$	(158) \$
VENTE	GBP	BNP Paribas S.A.	3 502 609	19/04/2024	4 431 277	4 441 348	(10 071)
Total							(25 292) \$
Global Opportunistic Bond Fund							
Plus-value							
VENTE	AUD	HSBC Bank	13 552 318	19/04/2024	9 119 425 \$	8 912 966 \$	206 459 \$
VENTE	AUD	State Street Bank Corp.	2 290 203	19/04/2024	1 534 090	1 506 200	27 890
VENTE	AUD	UBS AG	198 816	19/04/2024	131 586	130 755	831
VENTE	BRL	Barclays Bank PLC	906 730	02/02/2024 - 03/05/2024	182 742	182 156	586
VENTE	BRL	Citibank N.A.	8 443 223	02/02/2024	1 704 496	1 704 187	309
VENTE	BRL	Goldman Sachs International	9 384 459	02/02/2024 - 22/02/2024	1 907 055	1 891 890	15 165
ACHAT	CAD	State Street Bank Corp.	466 405	19/04/2024	345 480	347 263	1 783
ACHAT	CAD	UBS AG	1 974 328	19/04/2024	1 465 202	1 469 992	4 790
VENTE	CNH	UBS AG	56 056 003	19/04/2024	7 866 431	7 836 411	30 020
VENTE	CZK	BNP Paribas S.A.	89 913 685	19/04/2024	3 988 607	3 907 489	81 118
VENTE	CZK	Deutsche Bank AG	24 828 547	19/04/2024	1 086 887	1 079 005	7 882
VENTE	CZK	Merrill Lynch International	109 894 504	19/04/2024	4 875 857	4 775 820	100 037
VENTE	CZK	UBS AG	8 521 299	19/04/2024	373 454	370 321	3 133
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	2 657 129	19/04/2024	2 888 293	2 880 992	7 301
VENTE	EUR	Citibank N.A.	444 564	19/04/2024	485 005	482 018	2 987
VENTE	EUR	HSBC Bank	112 305 712	19/04/2024	122 732 249	121 767 464	964 785
VENTE	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	5 239 198	19/04/2024	5 729 002	5 680 601	48 401
VENTE	EUR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	100 000	19/04/2024	109 273	108 425	848
VENTE	EUR	NatWest Markets PLC	398 606	19/04/2024	434 875	432 189	2 686
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	15 543 022	19/04/2024	16 937 542	16 852 521	85 021
VENTE	EUR	UBS AG	4 329 853	19/04/2024	4 713 115	4 694 642	18 473
ACHAT	GBP	HSBC Bank	4 849 739	19/04/2024	6 147 226	6 149 524	2 298
ACHAT	GBP	State Street Bank Corp.	3 277 121	19/04/2024	4 151 378	4 155 427	4 049
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	857 595	19/04/2024	1 093 678	1 087 439	6 239
VENTE	GBP	UBS AG	98 739	19/04/2024	125 664	125 202	462
VENTE	JPY	Deutsche Bank AG	21 793 232	19/04/2024	150 168	149 870	298
VENTE	JPY	State Street Bank Corp.	257 449 273	19/04/2024	1 788 042	1 770 457	17 585
VENTE	JPY	UBS AG	1 178 550 292	19/04/2024	8 119 478	8 104 795	14 683
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	8 391 040 951	16/02/2024 - 04/04/2024	6 498 419	6 292 798	205 621
VENTE	KRW	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	1 395 750 000	16/02/2024	1 061 800	1 046 591	15 209
ACHAT	MXN	Deutsche Bank AG	32 040 640	19/04/2024	1 827 014	1 838 000	10 986
ACHAT	NZD	HSBC Bank	1 530 536	19/04/2024	933 401	935 577	2 176
ACHAT	NZD	State Street Bank Corp.	3 117 013	19/04/2024	1 902 252	1 905 350	3 098
VENTE	NZD	HSBC Bank	28 303 926	19/04/2024	17 434 200	17 301 464	132 736
ACHAT	PEN	Citibank N.A.	0	29/04/2024	0	0	0
VENTE	SEK	HSBC Bank	809 738	19/04/2024	79 177	78 043	1 134
VENTE	SGD	State Street Bank Corp.	62 773	19/04/2024	46 970	46 952	18
VENTE	THB	Barclays Bank PLC	77 766 780	03/04/2024	2 191 848	2 191 272	576
ACHAT	TWD	Citibank N.A.	359 302	25/04/2024	11 580	11 592	12
Total							2 027 685 \$

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/ réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Opportunistic Bond Fund – (suite)							
Moins-value							
ACHAT	AUD	UBS AG	1 352 655	19/04/2024	910 390 \$	889 602 \$	(20 788) \$
VENTE	AUD	JPMorgan Chase Bank N.A.	1 646 753	19/04/2024	1 080 530	1 083 022	(2 492)
VENTE	AUD	State Street Bank Corp.	197 140	19/04/2024	129 635	129 653	(18)
ACHAT	BRL	Barclays Bank PLC	6 409 494	02/02/2024	1 294 509	1 293 698	(811)
ACHAT	BRL	Citibank N.A.	8 443 223	02/02/2024	1 711 996	1 704 187	(7 809)
ACHAT	BRL	Goldman Sachs International	2 940 459	02/02/2024	593 612	593 505	(107)
VENTE	BRL	Barclays Bank PLC	5 956 129	02/02/2024	1 199 986	1 202 190	(2 204)
VENTE	CAD	HSBC Bank	383 367	19/04/2024	284 442	285 437	(995)
VENTE	CAD	State Street Bank Corp.	12 313 898	19/04/2024	9 137 845	9 168 347	(30 502)
VENTE	CNH	Barclays Bank PLC	9 051 000	19/04/2024	1 262 473	1 265 295	(2 822)
VENTE	CZK	Brown Brothers Harriman	24 867 582	19/04/2024	1 079 715	1 080 701	(986)
ACHAT	EUR	Barclays Bank PLC	7 472 823	19/04/2024	8 132 969	8 102 408	(30 561)
ACHAT	EUR	HSBC Bank	1 541 331	19/04/2024	1 695 051	1 671 188	(23 863)
ACHAT	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	5 792 537	19/04/2024	6 376 888	6 280 559	(96 329)
ACHAT	EUR	Merrill Lynch International	1 249 007	19/04/2024	1 363 187	1 354 236	(8 951)
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	16 528 411	19/04/2024	18 036 005	17 920 929	(115 076)
VENTE	EUR	Deutsche Bank AG	2 812 445	19/04/2024	3 048 691	3 049 394	(703)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	198 700	19/04/2024	253 665	251 954	(1 711)
ACHAT	GBP	JPMorgan Chase Bank N.A.	4 826 104	19/04/2024	6 144 670	6 119 554	(25 116)
VENTE	GBP	BNP Paribas S.A.	28 064 598	19/04/2024	35 505 534	35 586 227	(80 693)
ACHAT	HUF	BNP Paribas S.A.	5 352 978	19/04/2024	15 355	14 970	(385)
ACHAT	JPY	HSBC Bank	182 599 251	19/04/2024	1 258 188	1 255 720	(2 468)
VENTE	JPY	State Street Bank Corp.	417 962 329	19/04/2024	2 859 924	2 874 293	(14 369)
ACHAT	KRW	Barclays Bank PLC	4 357 000 000	16/02/2024	3 386 445	3 267 059	(119 386)
ACHAT	KRW	Merrill Lynch International	5 050 100 000	16/02/2024	3 904 515	3 786 774	(117 741)
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	404 264 895	16/02/2024	300 882	303 135	(2 253)
VENTE	KRW	Merrill Lynch International	28 477 892 385	26/04/2024	21 429 648	21 437 739	(8 091)
VENTE	MXN	Barclays Bank PLC	147 655 310	19/04/2024	8 457 551	8 470 196	(12 645)
VENTE	MXN	Deutsche Bank AG	16 020 320	19/04/2024	917 136	919 000	(1 864)
ACHAT	NOK	Deutsche Bank AG	11 360 770	19/04/2024	1 088 360	1 082 102	(6 258)
ACHAT	NOK	State Street Bank Corp.	58 440 630	19/04/2024	5 622 487	5 566 409	(56 078)
ACHAT	NZD	State Street Bank Corp.	12 897 735	19/04/2024	7 961 472	7 884 054	(77 418)
VENTE	NZD	JPMorgan Chase Bank N.A.	1 766 707	19/04/2024	1 078 972	1 079 943	(971)
ACHAT	SEK	State Street Bank Corp.	1 299 000	19/04/2024	126 982	125 198	(1 784)
ACHAT	THB	Barclays Bank PLC	61 765 872	03/04/2024	1 772 394	1 740 406	(31 988)
ACHAT	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	86 045 404	03/04/2024	2 480 052	2 424 543	(55 509)
Total							(961 745) \$

Global Total Return Fund**Plus-value**

VENTE	AUD	HSBC Bank	1 320 044	19/04/2024	888 264 \$	868 154 \$	20 110 \$
VENTE	AUD	State Street Bank Corp.	2 409 017	19/04/2024	1 613 678	1 584 340	29 338
ACHAT	CAD	HSBC Bank	4 720 489	19/04/2024	3 494 066	3 514 653	20 587
ACHAT	CAD	UBS AG	1 500 872	19/04/2024	1 113 837	1 117 479	3 642
VENTE	CAD	Brown Brothers Harriman	388 314	19/04/2024	289 163	289 121	42
VENTE	CHF	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	250 087	19/04/2024	295 331	292 218	3 113
ACHAT	COP	Barclays Bank PLC	2 535 685 147	17/04/2024	629 846	642 106	12 260
VENTE	CZK	BNP Paribas S.A.	52 854 608	19/04/2024	2 344 652	2 296 967	47 685

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/ réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Total Return Fund – (suite)							
Plus-value – (suite)							
VENTE	CZK	Deutsche Bank AG	33 068 039	19/04/2024	1 447 576 \$	1 437 078 \$	10 498 \$
VENTE	CZK	Merrill Lynch International	64 600 076	19/04/2024	2 866 210	2 807 405	58 805
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	2 438 262	19/04/2024	2 650 992	2 643 686	7 306
VENTE	EUR	Citibank N.A.	770 578	19/04/2024	840 675	835 499	5 176
VENTE	EUR	HSBC Bank	3 251 790	19/04/2024	3 554 371	3 525 753	28 618
VENTE	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	3 277 877	19/04/2024	3 592 639	3 554 038	38 601
VENTE	EUR	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	1 068 322	19/04/2024	1 164 777	1 158 328	6 449
VENTE	EUR	NatWest Markets PLC	398 606	19/04/2024	434 875	432 189	2 686
VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	18 817 991	19/04/2024	20 539 248	20 403 407	135 841
VENTE	EUR	UBS AG	5 994 803	19/04/2024	6 533 286	6 499 864	33 422
ACHAT	GBP	HSBC Bank	3 533 083	19/04/2024	4 478 315	4 479 988	1 673
VENTE	GBP	State Street Bank Corp.	494 480	19/04/2024	630 536	627 006	3 530
VENTE	GBP	UBS AG	98 739	19/04/2024	125 664	125 202	462
VENTE	JPY	Merrill Lynch International	102 136 640	19/04/2024	711 473	702 385	9 088
VENTE	JPY	State Street Bank Corp.	254 701 511	19/04/2024	1 770 419	1 751 562	18 857
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	11 764 156 987	16/02/2024 - 04/04/2024	9 114 394	8 821 863	292 531
ACHAT	MXN	Deutsche Bank AG	72 058 466	19/04/2024	4 108 899	4 133 608	24 709
ACHAT	NZD	HSBC Bank	2 439 075	19/04/2024	1 487 475	1 490 944	3 469
ACHAT	NZD	State Street Bank Corp.	6 976 946	19/04/2024	4 257 893	4 264 828	6 935
VENTE	NZD	HSBC Bank	29 508 961	19/04/2024	18 176 458	18 038 071	138 387
VENTE	THB	Barclays Bank PLC	51 787 060	03/04/2024	1 459 613	1 459 229	384
ACHAT	TWD	Citibank N.A.	3 161 242	25/04/2024	101 884	101 998	114
Total							964 318 \$
Moins-value							
ACHAT	AUD	UBS AG	2 590 508	19/04/2024	1 743 513 \$	1 703 702 \$	(39 811) \$
VENTE	AUD	JPMorgan Chase Bank N.A.	4 616 423	19/04/2024	3 029 104	3 036 087	(6 983)
VENTE	CAD	State Street Bank Corp.	2 177 458	19/04/2024	1 615 839	1 621 233	(5 394)
ACHAT	CHF	UBS AG	3 035 674	19/04/2024	3 605 848	3 547 086	(58 762)
ACHAT	CLP	Barclays Bank PLC	274 541 388	12/04/2024	295 829	293 870	(1 959)
ACHAT	CNH	State Street Bank Corp.	179 528 108	19/04/2024	25 190 492	25 097 331	(93 161)
VENTE	CNH	Barclays Bank PLC	14 681 000	19/04/2024	2 047 770	2 052 347	(4 577)
VENTE	CZK	Brown Brothers Harriman	33 035 007	19/04/2024	1 434 333	1 435 643	(1 310)
ACHAT	DKK	State Street Bank Corp.	8 736 495	19/04/2024	1 280 214	1 271 730	(8 484)
ACHAT	EUR	Barclays Bank PLC	1 794 493	19/04/2024	1 953 018	1 945 679	(7 339)
ACHAT	EUR	HSBC Bank	646 685	19/04/2024	711 181	701 169	(10 012)
ACHAT	EUR	JPMorgan Chase Bank N.A.	6 633 567	19/04/2024	7 303 910	7 192 444	(111 466)
ACHAT	EUR	Merrill Lynch International	396 188	19/04/2024	430 580	429 566	(1 014)
ACHAT	EUR	State Street Bank Corp.	15 711 579	19/04/2024	17 159 591	17 035 279	(124 312)
VENTE	EUR	Deutsche Bank AG	1 601 209	19/04/2024	1 735 711	1 736 111	(400)
ACHAT	GBP	JPMorgan Chase Bank N.A.	5 373 701	19/04/2024	6 841 880	6 813 914	(27 966)
VENTE	GBP	BNP Paribas S.A.	6 678 313	19/04/2024	8 448 974	8 468 176	(19 202)
VENTE	GBP	Morgan Stanley Capital Services, Inc.	365 200	19/04/2024	462 844	463 078	(234)
ACHAT	HUF	BNP Paribas S.A.	180 142 869	19/04/2024	516 733	503 786	(12 947)
ACHAT	IDR	Barclays Bank PLC	39 843 720 830	12/02/2024	2 565 597	2 524 591	(41 006)
ACHAT	JPY	HSBC Bank	4 580 841 051	19/04/2024	31 563 989	31 502 072	(61 917)
ACHAT	JPY	JPMorgan Chase Bank N.A.	174 439 062	19/04/2024	1 194 230	1 199 603	(5 373)
ACHAT	JPY	State Street Bank Corp.	65 248 467	19/04/2024	446 460	448 708	(2 248)

Type	Devise	Contrepartie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Total Return Fund – (suite)							
Moins-value – (suite)							
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	6 361 220 000	16/02/2024	4 944 210 \$	4 769 906 \$	(174 304) \$
ACHAT	KRW	Merrill Lynch International	7 437 420 000	16/02/2024	5 750 286	5 576 885	(173 401)
VENTE	KRW	Barclays Bank PLC	544 853 588	16/02/2024	405 518	408 554	(3 036)
VENTE	KRW	JPMorgan Chase Bank N.A.	19 400 436 177	26/04/2024	14 588 439	14 604 363	(15 924)
VENTE	MXN	Barclays Bank PLC	144 724 073	19/04/2024	8 289 653	8 302 047	(12 394)
VENTE	MXN	Deutsche Bank AG	36 029 233	19/04/2024	2 062 612	2 066 805	(4 193)
ACHAT	NOK	Deutsche Bank AG	15 092 063	19/04/2024	1 445 818	1 437 503	(8 315)
ACHAT	NOK	State Street Bank Corp.	50 190 309	19/04/2024	4 831 523	4 780 575	(50 948)
ACHAT	NZD	State Street Bank Corp.	12 710 733	19/04/2024	7 865 686	7 769 746	(95 940)
VENTE	NZD	JPMorgan Chase Bank N.A.	2 381 104	19/04/2024	1 454 200	1 455 508	(1 308)
ACHAT	PEN	Citibank N.A.	1 617 149	29/04/2024	431 527	424 364	(7 163)
ACHAT	PLN	HSBC Bank	2 341 330	19/04/2024	589 008	584 139	(4 869)
ACHAT	PLN	Merrill Lynch International	2 861 625	19/04/2024	720 105	713 948	(6 157)
ACHAT	SEK	State Street Bank Corp.	23 365 533	19/04/2024	2 284 060	2 251 969	(32 091)
ACHAT	SGD	State Street Bank Corp.	1 910 747	19/04/2024	1 429 788	1 429 178	(610)
ACHAT	THB	Barclays Bank PLC	29 255 549	03/04/2024	843 002	824 348	(18 654)
ACHAT	THB	JPMorgan Chase Bank N.A.	134 953 248	03/04/2024	3 889 703	3 802 643	(87 060)
Total							(1 342 244) \$

Inflation-Adjusted Bond Fund**Plus-value**

VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	1 172 913	19/04/2024	1 274 967 \$	1 271 731 \$	3 236 \$
-------	-----	-------------------------	-----------	------------	--------------	--------------	----------

Prudent Capital Fund**Plus-value**

VENTE	EUR	State Street Bank Corp.	336 764 130	19/04/2024	367 764 951 \$	365 136 496 \$	2 628 455 \$
-------	-----	-------------------------	-------------	------------	----------------	----------------	--------------

Moins-value

VENTE	GBP	BNP Paribas S.A.	5 050 890	19/04/2024	6 390 063 \$	6 404 585 \$	(14 522) \$
-------	-----	------------------	-----------	------------	--------------	--------------	-------------

Prudent Wealth Fund**Plus-value**

VENTE	EUR	HSBC Bank	270 350 000	19/04/2024	295 453 133 \$	293 126 978 \$	2 326 155 \$
-------	-----	-----------	-------------	------------	----------------	----------------	--------------

Note 11 : Contrats de change à terme ouverts spécifiques à certaines catégories

Au 31 janvier 2024, les compartiments étaient liés par les contrats de change à terme spécifiques à certaines catégories. Chaque compartiment avait en caisse suffisamment de liquidités et/ou d'autres titres pour faire face à tous les engagements existant au titre de ces contrats dérivés.

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Blended Research European Equity Fund								
Plus-value								
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	74 282	28/02/2024	86 952 €	87 031 €	79 €
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	1 195 962	28/02/2024	1 099 038	1 105 458	6 420
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	109 463	28/02/2024	100 591	101 179	588
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	300 185	28/02/2024	275 857	277 468	1 611
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	108 545	28/02/2024	99 749	100 331	582
Total								9 280 €

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Blended Research European Equity Fund – (suite)								
Moins-value								
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	5 835	28/02/2024	5 398 €	5 394 €	(4) €
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	5 768	28/02/2024	5 336	5 332	(4)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	9 129	28/02/2024	8 398	8 438	(40)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	616	28/02/2024	566	569	(3)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	1 688	28/02/2024	1 553	1 561	(8)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	610	28/02/2024	562	564	(2)
Total								(61) €
Continental European Equity Fund								
Plus-value								
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 638 840	28/02/2024	3 088 927 €	3 091 763 €	2 836 €
Moins-value								
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	41	28/02/2024	49 €	49 €	(0) €
Contrarian Value Fund								
Plus-value								
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	WSH1 (CHF)	2 241 445	28/02/2024	2 602 128 \$	2 604 692 \$	2 564 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	25 901	28/02/2024	28 117	28 022	95
Total								2 659 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	4 577 282	28/02/2024	4 980 660 \$	4 952 026 \$	(28 634) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	156 852	28/02/2024	170 684	169 694	(990)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 677 670	28/02/2024	1 825 607	1 815 021	(10 586)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH1 (EUR)	3 728 747	28/02/2024	4 056 505	4 034 021	(22 484)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	879 760	28/02/2024	1 120 537	1 115 149	(5 388)
Total								(68 082) \$
Diversified Income Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	10 626	28/02/2024	11 541 \$	11 496 \$	45 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	2 386 306	28/02/2024	2 596 743 \$	2 581 674 \$	(15 069) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	55 824	28/02/2024	60 747	60 395	(352)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	56 079	28/02/2024	61 024	60 670	(354)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	110 518	28/02/2024	120 263	119 566	(697)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	54 183	28/02/2024	69 012	68 680	(332)
Total								(16 804) \$
Emerging Markets Debt Fund								
Plus-value								
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	IH1 (CHF)	7 028 597	28/02/2024	8 159 574 \$	8 167 648 \$	8 074 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	373 090	28/02/2024	405 497	403 635	1 862
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	6 346 600	28/02/2024	6 898 253	6 866 198	32 055
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	1 596 122	28/02/2024	1 734 996	1 726 797	8 199
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH1 (EUR)	4 636	28/02/2024	5 040	5 016	24
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH2 (EUR)	839	28/02/2024	912	908	4
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	1 856	28/02/2024	2 018	2 008	10
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	82 321	28/02/2024	89 484	89 061	423

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Emerging Markets Debt Fund – (suite)								
Plus-value – (suite)								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH1 (EUR)	43	28/02/2024	47 \$	47 \$	0 \$
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	ISH2 (GBP)	161	28/02/2024	205	204	1
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	12 726	28/02/2024	16 200	16 131	69
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WSH2 (GBP)	165	28/02/2024	210	209	1
Total								50 722 \$
Moins-value								
VENTE	CHF	Brown Brothers Harriman	IH1 (CHF)	14 594	28/02/2024	16 945 \$	16 959 \$	(14) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	25 896 552	28/02/2024	28 180 239	28 016 713	(163 526)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	456 838 492	28/02/2024	497 124 414	494 240 045	(2 884 369)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	123 999 100	28/02/2024	134 932 184	134 150 956	(781 228)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH1 (EUR)	352 639	28/02/2024	383 736	381 510	(2 226)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH2 (EUR)	63 881	28/02/2024	69 515	69 111	(404)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	141 187	28/02/2024	153 638	152 746	(892)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	8 116 901	28/02/2024	8 832 690	8 781 435	(51 255)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH1 (EUR)	45 258	28/02/2024	49 249	48 963	(286)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	ISH2 (GBP)	56 104	28/02/2024	71 459	71 115	(344)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	5 317 512	28/02/2024	6 772 889	6 740 265	(32 624)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WSH2 (GBP)	55 839	28/02/2024	71 122	70 779	(343)
Total								(3 917 511) \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	73 815	28/02/2024	80 323 \$	79 858 \$	(465) \$
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	101 569	28/02/2024	129 368	128 745	(623)
Total								(1 088) \$
Emerging Markets Equity Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	60 934	28/02/2024	66 307 \$	65 923 \$	(384) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	62 030	28/02/2024	67 499	67 108	(391)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	577 667	28/02/2024	735 769	732 228	(3 541)
Total								(4 316) \$
Emerging Markets Equity Research Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	31 646	28/02/2024	34 437 \$	34 237 \$	(200) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	60 416	28/02/2024	65 744	65 363	(381)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	60 309	28/02/2024	65 626	65 246	(380)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	53 709	28/02/2024	68 408	68 079	(329)
Total								(1 290) \$
European Core Equity Fund								
Plus-value								
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	190 924	28/02/2024	223 488 €	223 693 €	205 €
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	4 697 221	28/02/2024	4 316 547	4 341 760	25 213
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	682 018	28/02/2024	626 745	630 406	3 661
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	1 475 884	28/02/2024	1 356 274	1 364 196	7 922
Total								37 001 €

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
European Core Equity Fund – (suite)								
Moins-value								
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	12 039	28/02/2024	14 108 €	14 105 €	(3) €
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 693	28/02/2024	3 150	3 155	(5)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	3 855	28/02/2024	3 546	3 563	(17)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	4 777	28/02/2024	4 395	4 416	(21)
Total								(46) €
European Research Fund								
Plus-value								
ACHAT	BRL	Standard Chartered Bank	IH1R (EUR)	3 037 835	02/02/2024 - 04/03/2024	564 001 €	566 271 €	2 270 €
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 712 516	28/02/2024	3 175 173	3 178 084	2 911
ACHAT	SGD	Brown Brothers Harriman	IH1 (SGD)	111 372	28/02/2024	76 461	76 829	368
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	31 942 289	28/02/2024	29 353 601	29 525 056	171 455
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	9 099 451	28/02/2024	8 362 005	8 410 850	48 845
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	5 860 390	28/02/2024	5 385 448	5 416 905	31 457
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	71 716 499	28/02/2024	65 904 678	66 289 351	384 673
Total								641 979 €
Moins-value								
VENTE	BRL	Standard Chartered Bank	IH1R (EUR)	1 479 394	02/02/2024	276 013 €	276 304 €	(291) €
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	10	28/02/2024	12	12	(0)
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	42 434	28/02/2024	49 639	49 717	(78)
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	1 807 805	28/02/2024	1 672 257	1 670 999	(1 258)
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	355 983	28/02/2024	329 292	329 044	(248)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	157 362	28/02/2024	144 776	145 454	(678)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	53 330	28/02/2024	49 056	49 294	(238)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	56 576	28/02/2024	52 098	52 295	(197)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	402 810	28/02/2024	370 534	372 328	(1 794)
Total								(4 782) €
European Smaller Companies Fund								
Plus-value								
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	17 743 064	28/02/2024	16 305 117 €	16 400 357 €	95 240 €
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	687 915	28/02/2024	632 165	635 858	3 693
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	3 041 609	28/02/2024	2 795 108	2 811 435	16 327
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	613 993	28/02/2024	564 233	567 529	3 296
Total								118 556 €
Moins-value								
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	37 268	28/02/2024	34 473 €	34 448 €	(25) €
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	97 074	28/02/2024	89 339	89 728	(389)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	2 879	28/02/2024	2 648	2 661	(13)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	NH1 (USD)	16 540	28/02/2024	15 215	15 289	(74)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	3 452	28/02/2024	3 176	3 191	(15)
Total								(516) €
European Value Fund								
Plus-value								
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	AH1 (CHF)	7 558 780	28/02/2024	8 063 129 €	8 119 045 €	55 916 €
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 409 962	28/02/2024	2 821 017	2 823 601	2 584
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	237 414 081	28/02/2024	218 178 333	219 447 765	1 269 432
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	109 661 379	28/02/2024	100 776 401	101 362 751	586 350
ACHAT	USD	Brown Brothers Harriman	WH1 (USD)	11 980 775	28/02/2024	11 010 067	11 074 130	64 063
Total								1 978 345 €

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
European Value Fund – (suite)								
Moins-value								
VENTE	CHF	Brown Brothers Harriman	AH1 (CHF)	78 485	28/02/2024	83 975 €	84 302 €	(327) €
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	AH1 (USD)	930 495	28/02/2024	857 378	860 080	(2 702)
VENTE	USD	Brown Brothers Harriman	IH1 (USD)	3 067	28/02/2024	2 824	2 835	(11)
Total								(3 040) €
Global Concentrated Fund								
Plus-value								
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	19 991	28/02/2024	25 287 \$	25 340 \$	53 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	70 991	28/02/2024	77 251 \$	76 803 \$	(448) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 450 432	28/02/2024	1 578 365	1 569 179	(9 186)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	341 555	28/02/2024	435 034	432 942	(2 092)
Total								(11 726) \$
Global Credit Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	127	28/02/2024	138 \$	137 \$	1 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	400 351	28/02/2024	435 616 \$	433 129 \$	(2 487) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	133 009	28/02/2024	144 738	143 897	(841)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	53 984	28/02/2024	68 759	68 428	(331)
Total								(3 659) \$
Global Equity Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	1 666 674	28/02/2024	1 809 086 \$	1 803 125 \$	5 961 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	77 168 122	28/02/2024	83 958 621 \$	83 485 907 \$	(472 714) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	231 834 700	28/02/2024	252 277 874	250 815 101	(1 462 773)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	63 553	28/02/2024	69 157	68 756	(401)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	8 444 770	28/02/2024	9 189 402	9 136 147	(53 255)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	4 021 436	28/02/2024	5 122 037	5 097 410	(24 627)
Total								(2 013 770) \$
Global Equity Income Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	787	28/02/2024	856 \$	852 \$	4 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	261 391	28/02/2024	284 442 \$	282 791 \$	(1 651) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	66 896	28/02/2024	72 795	72 373	(422)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	69 180	28/02/2024	75 280	74 844	(436)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	51 386	28/02/2024	65 449	65 135	(314)
Total								(2 823) \$
Global High Yield Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	239 336	28/02/2024	259 537 \$	258 931 \$	606 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH1 (EUR)	46 961	28/02/2024	51 103 \$	50 806 \$	(297) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	3 745 754	28/02/2024	4 076 073	4 052 420	(23 653)

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global High Yield Fund – (suite)								
Moins-value – (suite)								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH1 (EUR)	48 175	28/02/2024	52 423 \$	52 119 \$	(304) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH2 (EUR)	48 175	28/02/2024	52 423	52 119	(304)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	ISH2 (GBP)	40 906	28/02/2024	52 101	51 851	(250)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	55 542	28/02/2024	70 742	70 403	(339)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WSH2 (GBP)	41 485	28/02/2024	52 839	52 585	(254)
Total								(25 401) \$
Global Intrinsic Value Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	201	28/02/2024	218 \$	218 \$	0 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	30	28/02/2024	32	32	0
Total								0 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	1 642 722	28/02/2024	1 787 576 \$	1 777 213 \$	(10 363) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	5 906 277	28/02/2024	6 427 039	6 389 826	(37 213)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	65 619	28/02/2024	71 404	70 991	(413)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	172 506	28/02/2024	187 718	186 629	(1 089)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	59 097	28/02/2024	75 271	74 909	(362)
Total								(49 440) \$
Global Listed Infrastructure Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	49 070	28/02/2024	53 397 \$	53 087 \$	(310) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	49 204	28/02/2024	53 543	53 233	(310)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	49 191	28/02/2024	53 529	53 219	(310)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	42 381	28/02/2024	53 979	53 719	(260)
Total								(1 190) \$
Global New Discovery Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	67 117	28/02/2024	73 035 \$	72 611 \$	(424) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	39 229	28/02/2024	42 688	42 440	(248)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	71 106	28/02/2024	77 376	76 928	(448)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	60 141	28/02/2024	76 601	76 233	(368)
Total								(1 488) \$
Global Opportunistic Bond Fund								
Plus-value								
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	IH1 (CHF)	45 439	28/02/2024	52 750 \$	52 802 \$	52 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	288 221	28/02/2024	312 878	311 817	1 061
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	493	28/02/2024	535	533	2
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH1 (EUR)	1 656	28/02/2024	1 799	1 791	8
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	IH1 (GBP)	90 212	28/02/2024	114 643	114 349	294
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	IH2 (GBP)	45 776	28/02/2024	58 181	58 024	157
ACHAT	JPY	Brown Brothers Harriman	IH1 (JPY)	7 968 423	28/02/2024	54 181	54 361	180
Total								1 754 \$

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Global Opportunistic Bond Fund – (suite)								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	12 130 882	28/02/2024	13 199 985 \$	13 124 043 \$	(75 942) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	4 679 032	28/02/2024	5 091 519	5 062 105	(29 414)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	352 644	28/02/2024	383 740	381 516	(2 224)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	ISH1 (EUR)	349 880	28/02/2024	380 734	378 524	(2 210)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	1 545 485	28/02/2024	1 681 465	1 672 015	(9 450)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 808 127	28/02/2024	1 967 566	1 956 159	(11 407)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH1 (EUR)	11 046 561	28/02/2024	12 020 643	11 950 948	(69 695)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WSH2 (EUR)	47 947	28/02/2024	52 176	51 873	(303)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	IH1 (GBP)	7 223 607	28/02/2024	9 200 590	9 156 353	(44 237)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	IH2 (GBP)	7 054 454	28/02/2024	8 985 138	8 941 941	(43 197)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	ISH2 (GBP)	43 655	28/02/2024	55 603	55 336	(267)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	393 668	28/02/2024	501 408	498 997	(2 411)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WSH2 (GBP)	1 788 612	28/02/2024	2 278 125	2 267 174	(10 951)
VENTE	JPY	Brown Brothers Harriman	IH1 (JPY)	171 931	28/02/2024	1 166	1 173	(7)
Total								(301 715) \$
Global Research Focused Fund								
Plus-value								
ACHAT	JPY	Brown Brothers Harriman	IH1 (JPY)	323 974 159	28/02/2024	2 202 837 \$	2 210 171 \$	7 334 \$
Moins-value								
VENTE	JPY	Brown Brothers Harriman	IH1 (JPY)	11 228 516	28/02/2024	76 244 \$	76 601 \$	(357) \$
Global Strategic Equity Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	73 689	28/02/2024	80 185 \$	79 723 \$	(462) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	72 514	28/02/2024	78 908	78 450	(458)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	72 396	28/02/2024	78 780	78 323	(457)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	64 469	28/02/2024	82 113	81 718	(395)
Total								(1 772) \$
Global Total Return Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	31 906	28/02/2024	34 670 \$	34 519 \$	151 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	373 809	28/02/2024	405 587	404 412	1 175
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	42 227	28/02/2024	53 665	53 525	140
Total								1 466 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	15 279 767	28/02/2024	16 627 143 \$	16 530 727 \$	(96 416) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	4 085 292	28/02/2024	4 445 549	4 419 758	(25 791)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	110 165	28/02/2024	119 879	119 184	(695)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	2 081 793	28/02/2024	2 265 366	2 252 230	(13 136)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	7 229 308	28/02/2024	9 207 933	9 163 580	(44 353)
Total								(180 391) \$
Inflation-Adjusted Bond Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	61 478	28/02/2024	66 694 \$	66 511 \$	183 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	9 721 241	28/02/2024	10 578 433 \$	10 517 123 \$	(61 310) \$

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Limited Maturity Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	45 501	28/02/2024	49 513 \$	49 206 \$	(307) \$
Managed Wealth Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	53 039	28/02/2024	57 717 \$	57 381 \$	(336) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	58 533	28/02/2024	63 694	63 325	(369)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	122 015	28/02/2024	132 774	132 005	(769)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	57 415	28/02/2024	62 477	62 116	(361)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	51 922	28/02/2024	66 132	65 813	(319)
Total								(2 154) \$
Prudent Capital Fund								
Plus-value								
VENTE	BRL	Standard Chartered Bank	IH1R (USD)	25 925 554	02/02/2024	5 242 516 \$	5 232 834 \$	9 682 \$
ACHAT	CHF	Brown Brothers Harriman	AH1 (CHF)	1 067 852	28/02/2024	1 239 684	1 240 907	1 223
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	4 586 018	28/02/2024	4 984 126	4 961 478	22 648
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	3 349 155	28/02/2024	3 640 067	3 623 350	16 717
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	436 546	28/02/2024	474 432	472 287	2 145
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	1 172 013	28/02/2024	1 272 957	1 267 966	4 991
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	9 027	28/02/2024	11 491	11 442	49
ACHAT	JPY	Brown Brothers Harriman	ZH1 (JPY)	974 414 673	28/02/2024	6 625 458	6 647 515	22 057
Total								79 512 \$
Moins-value								
ACHAT	BRL	Standard Chartered Bank	IH1R (USD)	51 851 108	02/02/2024 - 04/03/2024	10 538 258 \$	10 452 604 \$	(85 654) \$
VENTE	CHF	Brown Brothers Harriman	AH1 (CHF)	29 148	28/02/2024	33 844	33 872	(28)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	180 984 752	28/02/2024	196 944 548	195 802 047	(1 142 501)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	119 431 540	28/02/2024	129 963 451	129 209 449	(754 002)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	14 759 450	28/02/2024	16 060 814	15 967 812	(93 002)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	28 228 347	28/02/2024	30 717 664	30 539 413	(178 251)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	1 701 635	28/02/2024	2 167 363	2 156 925	(10 438)
VENTE	JPY	Brown Brothers Harriman	ZH1 (JPY)	44 708 972	28/02/2024	303 262	305 007	(1 745)
Total								(2 265 621) \$
Prudent Wealth Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	1 556 714	28/02/2024	1 690 846 \$	1 684 162 \$	6 684 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	831 058	28/02/2024	902 403	899 098	3 305
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	444 305	28/02/2024	482 454	480 680	1 774
Total								11 763 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	246 871 543	28/02/2024	268 641 911 \$	267 083 016 \$	(1 558 895) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	165 098 875	28/02/2024	179 658 119	178 615 587	(1 042 532)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	21 135 483	28/02/2024	22 999 315	22 865 853	(133 462)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 873 010	28/02/2024	3 659 319	3 641 712	(17 607)
Total								(2 752 496) \$

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
U.S. Concentrated Growth Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	142 103	28/02/2024	154 633 \$	153 736 \$	(897) \$
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	677 810	28/02/2024	863 316	859 166	(4 150)
Total								(5 047) \$
U.S. Corporate Bond Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	4 055	28/02/2024	4 401 \$	4 387 \$	14 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	20 839	28/02/2024	22 652	22 545	107
VENTE	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	1 088	28/02/2024	1 381	1 379	2
Total								123 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	2 148 087	28/02/2024	2 337 510 \$	2 323 951 \$	(13 559) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	483 638	28/02/2024	526 196	523 234	(2 962)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	4 716 147	28/02/2024	5 131 909	5 102 260	(29 649)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	2 231 081	28/02/2024	2 841 693	2 828 029	(13 664)
Total								(59 834) \$
U.S. Government Bond Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	754 644	28/02/2024	818 966 \$	816 426 \$	2 540 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	1 789 420	28/02/2024	1 941 981	1 935 921	6 060
Total								8 600 \$
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	71 845 262	28/02/2024	78 180 496 \$	77 727 262 \$	(453 234) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH2 (EUR)	37 160 584	28/02/2024	40 437 166	40 202 936	(234 230)
Total								(687 464) \$
U.S. Growth Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	76 022	28/02/2024	82 725 \$	82 245 \$	(480) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	68 026	28/02/2024	74 025	73 595	(430)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	86 298	28/02/2024	93 907	93 363	(544)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	64 794	28/02/2024	82 527	82 131	(396)
Total								(1 850) \$
U.S. Total Return Bond Fund								
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	857 153	28/02/2024	932 736 \$	927 329 \$	(5 407) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	39 058 888	28/02/2024	42 503 086	42 256 655	(246 431)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	45 551	28/02/2024	49 567	49 280	(287)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	51 264	28/02/2024	65 294	64 980	(314)
Total								(252 439) \$
U.S. Value Fund								
Plus-value								
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	124 394	28/02/2024	135 147 \$	134 578 \$	569 \$
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	40 000	28/02/2024	43 369	43 275	94
VENTE	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	11 404	28/02/2024	14 487	14 455	32
Total								695 \$

Type	Devise	Contrepartie	Catégorie	Contrats portant livraison/réception	Plage de dates de règlement	En échange de	Contrats à leur valeur	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Moins-value								
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	AH1 (EUR)	14 887 827	28/02/2024	16 200 622 \$	16 106 700 \$	(93 922) \$
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	IH1 (EUR)	3 714 716	28/02/2024	4 042 276	4 018 841	(23 435)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	PH1 (EUR)	55 964	28/02/2024	60 898	60 545	(353)
ACHAT	EUR	Brown Brothers Harriman	WH1 (EUR)	14 211 238	28/02/2024	15 464 380	15 374 718	(89 662)
ACHAT	GBP	Brown Brothers Harriman	WH1 (GBP)	1 033 326	28/02/2024	1 316 130	1 309 803	(6 327)
Total								(213 699) \$

Note 12 : Accords de mise en pension

Détails des accords de mise en pension en circulation au 31 janvier 2024 :

Compartiment	Contrepartie	Date d'échéance	Taux d'intérêt	Devise	Valeur de marché	Garantie
Asia Ex-Japan Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	702 449	716 608
Contrarian Value Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	55 456 704	56 565 842
Diversified Income Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	1 972 840	2 012 962
Emerging Markets Debt Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	169 666 783	173 060 169
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	2 661 999	2 715 324
Emerging Markets Equity Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	1 280 771	1 306 442
Emerging Markets Equity Research Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	121 605	124 047
Global Credit Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	2 927 490	2 986 129
Global Equity Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	11 119 871	11 342 280
Global Equity Income Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	206 516	210 724
Global High Yield Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	8 924 023	9 102 521
Global Intrinsic Value Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	1 193 497	1 217 386
Global Listed Infrastructure Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	81 157	82 853
Global New Discovery Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	343 509	350 439
Global Opportunistic Bond Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	13 711 012	13 986 015
Global Research Focused Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	1 594 658	1 626 582
Global Strategic Equity Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	77 440	79 860
Global Total Return Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	21 540 189	21 971 195
Inflation-Adjusted Bond Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	4 194 815	4 278 776
Limited Maturity Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	15 298 305	15 604 361
Managed Wealth Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	681 714	695 456
Prudent Capital Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	235 682 436	240 396 171

Compartiment – (suite)	Contrepartie	Date d'échéance	Taux d'intérêt	Devise	Valeur de marché	Garantie
Prudent Wealth Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	194 329 143	198 215 788
U.S. Concentrated Growth Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	1 353 652	1 380 763
U.S. Corporate Bond Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	13 509 481	13 779 833
U.S. Government Bond Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	980 771	1 000 387
U.S. Growth Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	521 803	537 458
U.S. Total Return Bond Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	24 149 025	24 632 050
U.S. Value Fund	Fixed Income Clearing Corp. – State Street Bank & Trust Co.	01/02/2024	5,29 %	USD	6 782 312	6 918 007

Au 31 janvier 2024, pour les accords de mise en pension avec Fixed Income Clearing Corp. - State Street Bank & Trust Co. qui sont détenus par le Dépositaire, des garanties d'une valeur de marché de 806 896 428 USD ont été reçues. Les garanties reçues consistaient en des emprunts de haute qualité de l'État américain et d'organismes fédéraux américains.

Note 13 : Contrats à terme standardisés ouverts

Au 31 janvier 2024, les compartiments étaient liés par les contrats à terme standardisés suivants. Chaque compartiment avait en caisse suffisamment de liquidités et/ou d'autres titres pour faire face à tous les engagements existant au titre de ces contrats dérivés.

Description	Devise	Contrepartie	Expiration	Notionnel	Contrats	Plus-value (moins-value) nette non réalisée
Diversified Income Fund						
Obligation du Trésor américain à 30 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc	Mars 2024	200 000	2	14 446 \$
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc	Mars 2024	1 000 000	10	19 279
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc	Mars 2024	400 000	2	(608)
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc	Mars 2024	1 700 000	17	11 594
Bon du Trésor américain Ultra à 30 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc	Mars 2024	600 000	6	44 397
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc	Mars 2024	500 000	5	34
Total						89 142 \$
Emerging Markets Debt Fund						
Obligation du Trésor américain à 30 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	36 800 000	368	2 549 370 \$
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	73 600 000	736	2 230 508
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	65 100 000	651	1 341 245
Bon du Trésor américain Ultra à 30 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	7 700 000	77	610 217
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	37 100 000	371	1 472 821
Total						8 204 161 \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
Euro-Bobl à 5 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	1 000 000	10	5 605 \$
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	400 000	4	10 029
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	1 200 000	6	11 129
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	2 100 000	21	38 877
Total						65 640 \$

Description	Devise	Contrepartie	Expiration	Notionnel	Contrats	Plus-value (moins- value) nette non réalisée
Euro Credit Fund						
Euro-Bobl à 5 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	4 000 000	40	8 400 €
Euro-Bund à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	8 700 000	87	(88 280)
Euro-Schatz à 2 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	12 500 000	125	5 465
Gilt longue échéance à 10 ans (court)	GBP	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	5 800 000	58	(184 226)
Obligation du Trésor américain à 30 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	300 000	3	(20 276)
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	6 900 000	69	(97 549)
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	2 900 000	29	(110 062)
Total						(486 528) €
Global Credit Fund						
Euro-Bobl à 5 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	3 900 000	39	(22 846) \$
Euro-Bund à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	1 600 000	16	(1 721)
Euro-Buxl à 30 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	400 000	4	21 087
Gilt longue échéance à 10 ans (court)	GBP	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	1 000 000	10	(30 119)
Obligation du Trésor américain à 30 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	4 100 000	41	281 049
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	9 200 000	46	74 594
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	1 700 000	17	(36 472)
Bon du Trésor américain Ultra à 30 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	600 000	6	50 405
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	5 200 000	52	(210 178)
Total						125 799 \$
Global High Yield Fund						
Gilt longue échéance à 10 ans (court)	GBP	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	200 000	2	(8 041) \$
Global Opportunistic Bond Fund						
Euro-Bobl à 5 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	17 200 000	172	80 469 \$
Euro-Bund à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	6 300 000	63	(51 539)
Euro-Buxl à 30 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	600 000	6	(38 748)
Euro-Schatz à 2 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	26 500 000	265	(29 834)
Gilt longue échéance à 10 ans (long)	GBP	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	1 600 000	16	10 379
Obligation du Trésor américain à 30 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	5 400 000	54	353 195
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	8 000 000	80	185 610
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	32 400 000	162	(41 694)
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	14 500 000	145	217 151
Bon du Trésor américain Ultra à 30 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	2 800 000	28	125 098
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	3 100 000	31	(12 172)
Total						797 915 \$
Global Total Return Fund						
Euro-Bobl à 5 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	22 700 000	227	127 245 \$
Euro-Bund à 10 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	15 500 000	155	(244 818)
Euro-Buxl à 30 ans (long)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	2 400 000	24	126 518
Euro-Schatz à 2 ans (court)	EUR	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	18 800 000	188	(9 676)
Gilt longue échéance à 10 ans (long)	GBP	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	2 400 000	24	78 736
Obligation du Trésor américain à 30 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	7 300 000	73	527 265
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	13 500 000	135	428 972
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	12 000 000	60	(15 256)
Bon du Trésor américain Ultra à 30 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	1 600 000	16	(47 534)
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BofA Securities, Inc.	Mars 2024	2 600 000	26	(39 227)
Total						932 225 \$

Description	Devise	Contrepartie	Expiration	Notionnel	Contrats	Plus-value (moins- value) nette non réalisée
Inflation-Adjusted Bond Fund						
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	8 400 000	42	77 901 \$
Bon du Trésor américain Ultra à 30 ans (court)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	400 000	4	(33 793)
Total						44 108 \$
Limited Maturity Fund						
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	63 600 000	318	589 824 \$
Managed Wealth Fund						
Indice Mini MSCI EAFE (court)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	1 250	25	(85 474) \$
Indice Russell 1000 Growth (court)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	950	19	(137 843)
Indice Russell 1000 Value (court)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	1 700	34	(102 622)
Total						(325 939) \$
U.S. Corporate Bond Fund						
Obligation du Trésor américain à 30 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	9 300 000	93	551 126 \$
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	43 400 000	217	402 490
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	12 200 000	122	(260 775)
Bon du Trésor américain Ultra à 30 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	6 600 000	66	554 459
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (court)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	26 200 000	262	(1 052 288)
Total						195 012 \$
U.S. Government Bond Fund						
Obligation du Trésor américain à 30 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	2 900 000	29	111 810 \$
Bon du Trésor américain à 10 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	12 100 000	121	182 867
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	20 800 000	104	(16 090)
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	38 600 000	386	70 482
Bon du Trésor américain Ultra à 30 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	10 900 000	109	640 474
Bon du Trésor américain Ultra à 10 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	8 200 000	82	21 361
Total						1 010 904 \$
U.S. Total Return Bond Fund						
Bon du Trésor américain à 2 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	55 800 000	279	517 488 \$
Bon du Trésor américain à 5 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	24 600 000	246	256 425
Bon du Trésor américain Ultra à 30 ans (long)	USD	BoFA Securities, Inc.	Mars 2024	18 100 000	181	1 363 107
Total						2 137 020 \$

Les Bilans reflètent la marge de variation quotidienne nette éventuelle au 31 janvier 2024 sur les contrats à terme standardisés ouverts, laquelle pourrait différer de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée indiquée ci-avant.

Note 14 : Contrats de swap

Au 31 janvier 2024, les compartiments étaient liés par les contrats de swap en circulation suivants. Chaque compartiment avait en caisse suffisamment de liquidités et/ou d'autres titres pour faire face à tous les engagements existant au titre de ces contrats dérivés.

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Emerging Markets Debt Fund						
Contrats de swap non compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Moins-value						
20/12/2024	USD	6 313 000 (a)	Barclays Bank PLC	(1)	1,00 %/trimestre	(43 081) \$

(1) Le compartiment, en tant qu'acheteur de la protection, recevra un montant notionnel en cas de survenance d'un événement de crédit déterminé de la part de la Corée du Sud, 2,75 %, 19/01/2027.

(a) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 36 348 \$.

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
Contrats de swap non compensés						
Swaps de taux d'intérêt						
Plus-value						
07/07/2027	MYR	1 984 000	JPMorgan Chase Bank N.A.	3,65 % / trimestre	KLIBOR 3 mois / trimestre	2 835 \$
Contrats de swap compensés						
Swaps de taux d'intérêt						
Plus-value						
20/09/2025	CLP	265 000 000	compensation centralisée	5,61 % / semestre	CLOIS quotidien / semestre	3 913 \$
20/06/2027	CZK	14 000 000 (a)	compensation centralisée	3,94 % / an	PRIBOR / semestre	10 178
22/12/2027	CZK	46 857 000 (b)	compensation centralisée	3,17 % / an	PRIBOR / semestre	4 178
02/01/2029	BRL	1 189 000	compensation centralisée	11,18 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien / à l'échéance	7 347
02/01/2029	BRL	1 000 000	compensation centralisée	11,12 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien / à l'échéance	5 865
13/04/2032	USD	165 000	compensation centralisée	3,116 % / à l'échéance	USA-CPI-U / à l'échéance	4 060
20/06/2034	THB	9 500 000	compensation centralisée	3,475 % / trimestre	THBFIX 3 mois / trimestre	19 363
Total						54 904 \$
Moins-value						
02/01/2026	BRL	1 200 000	compensation centralisée	10,045 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien / à l'échéance	(560) \$
02/01/2026	BRL	2 846 000	compensation centralisée	9,9975 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien / à l'échéance	(222)
02/01/2026	BRL	2 326 000	compensation centralisée	10,08 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien / à l'échéance	(1 285)
22/12/2027	CZK	52 293 000 (c)	compensation centralisée	3,05 % / an	PRIBOR / semestre	(377)
02/01/2029	BRL	4 326 000	compensation centralisée	10,255 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien / à l'échéance	(1 550)
18/12/2030	MXN	14 739 000	compensation centralisée	7,905 % / 28 jours	TIIE 28 jours / 28 jours	(3 631)
18/12/2030	MXN	4 063 000 (d)	compensation centralisée	7,85 % / 28 jours	TIIE 28 jours / 28 jours	(1 452)
17/12/2031	PLN	1 227 000 (e)	compensation centralisée	3,86 % / an	WIBOR / semestre	(6 328)
28/04/2033	USD	265 000	compensation centralisée	3,149 % / an	SOFR quotidien / an	(10 019)
28/04/2033	CLP	215 517 000	compensation centralisée	CLOIS quotidien / semestre	5,17 % / semestre	(7 596)
23/10/2033	CLP	120 090 000	compensation centralisée	CLOIS quotidien / semestre	6,1 % / semestre	(13 267)
20/12/2033	HUF	135 315 000	compensation centralisée	6,05 % / an	BUBOR / semestre	(1 837)
Total						(48 124) \$

(a) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 3 162 \$.

(b) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 1 227 \$.

(c) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 2 034 \$.

(d) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 24 \$.

(e) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 538 \$.

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Euro Credit Fund						
Contrats de swap non compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Plus-value						
20/06/2028	EUR	450 000 (a)	Barclays Bank PLC	5,00 % / trimestre	(1)	67 966 €
Contrats de swap compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Moins-value						
20/12/2028	EUR	3 800 000 (b)	compensation centralisée	(2)	5,00 % / trimestre	(268 353) €
(1) Le compartiment, en tant que vendeur de la protection, doit verser un montant notionnel en cas de survenance d'un événement de crédit déterminé de la part de Glencore Funding LLC, 1,875 %, 13/09/2023, obligation notée BBB+. Le compartiment a conclu le contrat pour obtenir une exposition.						
(2) Le compartiment reçoit, en tant qu'acheteur de la protection, un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Crossover Series 40.						
(a) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 52 400 €.						
(b) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 248 052 €.						

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Global Credit Fund						
Contrats de swap non compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Plus-value						
20/06/2028	EUR	420 000 (a)	Barclays Bank PLC	5,00 % / trimestre	(1)	68 554 \$
Contrats de swap compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Moins-value						
20/12/2028	EUR	2 010 000 (b)	compensation centralisée	(2)	5,00 % / trimestre	(153 339) \$
(1) Le compartiment, en tant que vendeur de la protection, doit verser un montant notionnel en cas de survenance d'un événement de crédit déterminé de la part de Glencore Funding LLC, 1,875 %, 13/09/2023, obligation notée BBB+. Le compartiment a conclu le contrat pour obtenir une exposition.						
(2) Le compartiment reçoit, en tant qu'acheteur de la protection, un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Crossover Series 40.						
(a) Les primes nettes non amorties versées (reçues) par le compartiment se sont élevées à 54 068 \$.						
(b) Les primes nettes non amorties versées (reçues) par le compartiment se sont élevées à 140 872 \$.						

Expiration		Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
Global Opportunistic Bond Fund						
Contrats de swap non compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Plus-value						
20/06/2028	EUR	550 000 (a)	Barclays Bank PLC	5,00 % / trimestre	(1)	89 773 \$
Contrats de swap compensés						
Swaps sur défaillance de crédit						
Moins-value						
20/12/2028	EUR	9 470 000 (b)	compensation centralisée	(2)	5,00 % / trimestre	(722 731) \$
Contrats de swap compensés						
Swaps de taux d'intérêt						
Plus-value						
02/01/2026	BRL	13 500 000	compensation centralisée	11,095 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien moyen / à l'échéance	38 235 \$
02/01/2026	BRL	13 500 000	compensation centralisée	10,48 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien moyen / à l'échéance	6 828
04/01/2027	BRL	14 500 000	compensation centralisée	10,363 % / à l'échéance	BZDIOVRA quotidien moyen / à l'échéance	11 795
18/06/2027	USD	79 800 000	compensation centralisée	3,412 % / an	SOFR - 1 jour / an	249 315
21/03/2029	CNY	66 853 000 (c)	compensation centralisée	2,38 % / trimestre	CFRR / trimestre	112 096
Total						418 269 \$

Expiration	Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
------------	-------------------	--------------	-------------------------------	-----------------------------	------------------

Global Opportunistic Bond Fund – (suite)**Moins-value**

18/06/2055	USD	8 400 000	compensation centralisée	SOFR - 1 jour / an	3,458 % / an	(67 766) \$
------------	-----	-----------	--------------------------	--------------------	--------------	-------------

(1) Le compartiment, en tant que vendeur de la protection, doit verser un montant notionnel en cas de survenance d'un événement de crédit déterminé de la part de Glencore Funding LLC, 1,875 %, 13/09/2023, obligation notée BBB+. Le compartiment a conclu le contrat pour obtenir une exposition.

(2) Le compartiment reçoit, en tant qu'acheteur de la protection, un montant notionnel lors d'un événement de crédit défini, en fonction d'une obligation de référence spécifiée dans l'indice iTraxx Europe Crossover Series 40.

(a) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 70 813 \$.

(b) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 675 065 \$.

(c) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 41 415 \$.

Expiration	Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
------------	-------------------	--------------	-------------------------------	-----------------------------	------------------

Global Total Return Fund**Contrats de swap non compensés****Swaps sur défaillance de crédit****Plus-value**

20/06/2028	EUR	1 230 000 (a)	Barclays Bank PLC	5,00 % / trimestre	(1)	200 765 \$
------------	-----	---------------	-------------------	--------------------	-----	------------

Contrats de swap compensés**Swaps de taux d'intérêt****Plus-value**

18/06/2027	USD	50 000 000	compensation centralisée	3,412 % / an	SOFR - 1 jour/an	156 212 \$
------------	-----	------------	--------------------------	--------------	------------------	------------

Moins-value

18/06/2055	USD	5 300 000	compensation centralisée	SOFR - 1 jour / an	3,458 % / an	(42 757) \$
------------	-----	-----------	--------------------------	--------------------	--------------	-------------

(1) Le compartiment, en tant que vendeur de la protection, doit verser un montant notionnel en cas de survenance d'un événement de crédit déterminé de la part de Glencore Funding LLC, 1,875 %, 13/09/2023, obligation notée BBB+. Le compartiment a conclu le contrat pour obtenir une exposition.

(a) Les primes nettes non amorties versées par le compartiment se sont élevées à 158 372 \$.

Expiration	Montant notionnel	Contrepartie	Flux de trésorerie à recevoir	Flux de trésorerie à verser	Valeur de marché
------------	-------------------	--------------	-------------------------------	-----------------------------	------------------

Limited Maturity Fund**Contrats de swap compensés****Swaps de taux d'intérêt****Plus-value**

02/10/2025	USD	22 300 000 (a)	compensation centralisée	5,014 % / an	SOFR quotidien / an	257 305 \$
------------	-----	----------------	--------------------------	--------------	---------------------	------------

02/01/2026	USD	136 800 000 (b)	compensation centralisée	4,697 % / an	SOFR quotidien / an	2 748 880
------------	-----	-----------------	--------------------------	--------------	---------------------	-----------

Total						3 006 185 \$
--------------	--	--	--	--	--	---------------------

(a) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 1 741 \$.

(b) Les primes nettes non amorties reçues par le compartiment se sont élevées à 10 967 \$.

Les abréviations suivantes sont utilisées dans ce rapport et sont définies comme suit :

BUBOR	Budapest Interbank Offered Rate
BZDIOVRA	Taux de dépôt interbancaire brésilien
CFRR	China Fixing Repo Rate
CLOIS	Sinacofi Chile Interbank Rate Average
KLIBOR	Kuala Lumpur Interbank Offered Rate
PRIBOR	Prague Interbank Offered Rate
SOFR	Secured Overnight Financing Rate
THBFIX	Thai Baht Floating Rate Fixed
TIIE	Interbank Equilibrium Interest Rate
USA-CPI-U	Indice des prix à la consommation pour tous les consommateurs urbains
WIBOR	Warsaw Interbank Offered Rate

Note 15 : Frais de transaction

Pour l'exercice clos le 31 janvier 2024, les compartiments ont engagé des frais de transaction, qui ont été définis comme des commissions de courtage (pouvant comprendre des coûts liés à la recherche, voir la Note 7) au titre de l'achat ou de la vente de valeurs mobilières, d'instruments du marché monétaire, d'instruments dérivés ou d'autres actifs éligibles et comme des frais facturés par le Dépositaire pour l'exécution des transactions des compartiments. Les commissions de courtage sont portées au poste « Coût identifié » des Tableaux des investissements ou au poste « Plus-values

(moins-values) nettes réalisées sur les placements, les produits dérivés et les opérations de change » dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Le remboursement de la recherche par MFS, le cas échéant, est comptabilisé au poste « Autre » dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net. Les frais facturés par le Dépositaire sont portés au poste « Commission de dépositaire » dans les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net.

Compartiment	Frais de transaction
Asia Ex-Japan Fund	96 796 \$
Blended Research European Equity Fund	43 094 €
Continental European Equity Fund	50 067 €
Contrarian Value Fund	291 409 \$
Diversified Income Fund	37 656 \$
Emerging Markets Debt Fund	125 052 \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	35 604 \$
Emerging Markets Equity Fund	104 955 \$
Emerging Markets Equity Research Fund	19 428 \$
Euro Credit Fund	17 715 €
European Core Equity Fund	16 376 €
European Research Fund	698 274 €
European Smaller Companies Fund	74 210 €
European Value Fund	1 334 015 €
Global Concentrated Fund	88 740 \$
Global Credit Fund	21 461 \$
Global Equity Fund	338 379 \$
Global Equity Income Fund	33 820 \$
Global High Yield Fund	10 444 \$
Global Intrinsic Value Fund	44 478 \$
Global Listed Infrastructure Fund (c)	4 069 \$
Global New Discovery Fund	16 289 \$
Global Opportunistic Bond Fund	105 578 \$
Global Research Focused Fund	24 444 \$
Global Strategic Equity Fund	4 502 \$
Global Total Return Fund	285 773 \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	20 621 \$
Japan Equity Fund	1 100 630 ¥
Limited Maturity Fund	11 043 \$
Managed Wealth Fund	20 861 \$
Prudent Capital Fund	432 246 \$
Prudent Wealth Fund	536 055 \$
U.K. Equity Fund	11 702 £
U.S. Concentrated Growth Fund	20 014 \$
U.S. Corporate Bond Fund	36 056 \$
U.S. Government Bond Fund	73 016 \$
U.S. Growth Fund	5 888 \$
U.S. Total Return Bond Fund	22 432 \$
U.S. Value Fund	123 237 \$

(c) Le compartiment a commencé ses activités le 13 septembre 2023.

Note 16 : Résumé des différences comptables entre les exigences légales et réglementaires luxembourgeoises en matière de fonds d'investissement et les principes comptables généralement admis aux États-Unis

Les états financiers du fonds sont préparés en application des exigences légales et réglementaires luxembourgeoises en matière de fonds d'investissement. Ces exigences sont différentes des principes comptables généralement admis aux États-Unis (« U.S. GAAP ») dans la manière dont la décote s'accumule et la prime est amortie en revenus à l'égard de certains titres à revenu fixe. Ces différences ne modifient pas le résultat d'exploitation total, mais peuvent avoir un impact sur les montants déclarés des revenus de placements nets et de la variation des plus-values (moins-values) réalisées et non réalisées sur les placements, les instruments dérivés et les conversions de devises. Ces différences n'ont aucune incidence sur l'actif net des compartiments. Les différences importantes et l'impact sur les états financiers pour les compartiments concernés s'établissent comme suit :

	Exigences légales et réglementaires luxembourgeoises	Principes comptables généralement admis aux États-Unis	
Titres à revenu fixe	La prime sur les titres à revenu fixe ne doit pas nécessairement être amortie quotidiennement sous forme de revenu. La décote sur les certificats de coupon ne doit pas nécessairement s'accumuler quotidiennement sous forme de revenu.	La prime sur les titres à revenu fixe est amortie quotidiennement sous forme de revenu. La décote sur les certificats de coupon s'accumule quotidiennement en tant que revenu.	
Compartiment	Total des revenus de placements nets en application des prescriptions légales et réglementaires luxembourgeoises	Ajustement net au titre de l'accroissement de la décote et de l'amortissement de la prime sur certains titres à revenu fixe	Total des revenus de placements nets en application des principes comptables généralement admis aux États-Unis
Diversified Income Fund	2 481 975 \$	(114 251) \$	2 367 724 \$
Emerging Markets Debt Fund	138 667 017 \$	(9 745 044) \$	128 921 973 \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	1 628 145 \$	(32 319) \$	1 595 826 \$
Euro Credit Fund	3 758 665 €	(39 886) €	3 718 779 €
Global Credit Fund	3 686 683 \$	(134 564) \$	3 552 119 \$
Global High Yield Fund	11 384 552 \$	(611 775) \$	10 772 777 \$
Global Opportunistic Bond Fund	14 762 067 \$	(428 403) \$	14 333 664 \$
Global Total Return Fund	23 422 675 \$	(985 199) \$	22 437 476 \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	6 455 824 \$	(1 349 945) \$	5 105 879 \$
Limited Maturity Fund	32 755 548 \$	(1 671 996) \$	31 083 552 \$
Prudent Capital Fund	44 117 093 \$	(1 735 531) \$	42 381 562 \$
Prudent Wealth Fund	20 136 219 \$	(563 688) \$	19 572 531 \$
U.S. Corporate Bond Fund	19 434 195 \$	(467 384) \$	18 966 811 \$
U.S. Government Bond Fund	11 070 273 \$	(388 949) \$	10 681 324 \$
U.S. Total Return Bond Fund	30 476 732 \$	(698 367) \$	29 778 365 \$

Compartiment	Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les instruments dérivés et les conversions de devises en application des exigences légales et réglementaires luxembourgeoises	Ajustement net au titre de l'accroissement de la décote et de l'amortissement de la prime sur certains titres à revenu fixe	Plus-values (moins-values) nettes réalisées sur les placements, les instruments dérivés et les conversions de devises en application des principes comptables généralement admis aux États-Unis
Diversified Income Fund	(3 495 468) \$	146 239 \$	(3 349 229) \$
Emerging Markets Debt Fund	(206 557 462) \$	7 133 313 \$	(199 424 149) \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	(1 209 972) \$	58 760 \$	(1 151 212) \$
Euro Credit Fund	(2 067 870) €	36 095 €	(2 031 775) €
Global Credit Fund	(6 601 240) \$	246 163 \$	(6 355 077) \$
Global High Yield Fund	(10 178 629) \$	637 044 \$	(9 541 585) \$
Global Opportunistic Bond Fund	(21 613 316) \$	821 861 \$	(20 791 455) \$
Global Total Return Fund	8 442 382 \$	1 595 204 \$	10 037 586 \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	(23 674 464) \$	3 590 188 \$	(20 084 276) \$
Limited Maturity Fund	(15 754 484) \$	3 393 457 \$	(12 361 027) \$
Prudent Capital Fund	(138 794 319) \$	4 122 872 \$	(134 671 447) \$
Prudent Wealth Fund	(50 780 828) \$	1 367 347 \$	86 939 817 \$
U.S. Corporate Bond Fund	(31 564 524) \$	962 962 \$	(22 999 528) \$
U.S. Government Bond Fund	(13 598 974) \$	1 362 839 \$	(12 236 135) \$
U.S. Total Return Bond Fund	(12 585 204) \$	877 632 \$	(11 707 572) \$

Compartiment	Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les instruments dérivés et les conversions de devises en application des exigences légales et réglementaires luxembourgeoises	Ajustement net au titre de l'accroissement de la décote et de l'amortissement de la prime sur certains titres à revenu fixe	Variation nette des plus-values (moins-values) non réalisées sur les placements, les instruments dérivés et les conversions de devises en application des principes comptables généralement admis aux États-Unis
Diversified Income Fund	2 520 516 \$	(31 988) \$	2 488 528 \$
Emerging Markets Debt Fund	158 243 540 \$	2 611 731 \$	160 855 271 \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	995 194 \$	(26 441) \$	968 753 \$
Euro Credit Fund	7 758 781 €	3 791 €	7 762 572 €
Global Credit Fund	8 469 610 \$	(111 599) \$	8 358 011 \$
Global High Yield Fund	17 710 771 \$	(25 269) \$	17 685 502 \$
Global Opportunistic Bond Fund	22 133 709 \$	(393 458) \$	21 740 251 \$
Global Total Return Fund	5 341 483 \$	(610 005) \$	4 731 478 \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	15 899 153 \$	(2 240 243) \$	13 658 910 \$
Limited Maturity Fund	27 036 270 \$	(1 721 461) \$	25 314 809 \$
Prudent Capital Fund	375 162 230 \$	(2 387 341) \$	372 774 889 \$
Prudent Wealth Fund	273 844 034 \$	(803 659) \$	273 040 375 \$
U.S. Corporate Bond Fund	33 613 859 \$	(495 578) \$	33 118 281 \$
U.S. Government Bond Fund	1 240 893 \$	(973 890) \$	267 003 \$
U.S. Total Return Bond Fund	11 374 510 \$	(179 265) \$	11 195 245 \$

Note 17 : Conflit entre la Russie et l'Ukraine

Les perturbations du marché, qui ont commencé fin février 2022, associées à des événements géopolitiques liés au conflit entre la Russie et l'Ukraine, peuvent avoir un impact négatif sur la valeur des actifs des compartiments et donc sur la performance des compartiments. En outre, les fonds Diversified Income Fund, Emerging Markets Debt Fund, Emerging Markets Equity Fund, Emerging Markets Equity Research Fund, Global Equity Income Fund et Global Total Return Fund investissent dans des titres et/ou des instruments dérivés qui sont économiquement liés à la Russie et/ou à l'Ukraine. L'escalade du conflit entre la Russie et l'Ukraine fin février 2022 a entraîné une volatilité du marché et une perturbation de la négociabilité des titres russes, notamment la fermeture du marché boursier local, la restriction temporaire des ventes de titres par les non-résidents et des perturbations dans les systèmes de compensation et de paiement. Dans la mesure où les compartiments sont incapables de vendre des titres, que ce soit en raison de contraintes de marché ou des sanctions imposées à la Russie par les États-Unis et d'autres pays, ces titres seront considérés comme illiquides et leur valeur reflétera cette classification d'illiquidité. Cela peut avoir un impact négatif sur la performance des compartiments et/ou leur capacité à atteindre leurs objectifs d'investissement. La direction continue de suivre ces événements et d'évaluer leur impact, le cas échéant, pour les compartiments.

Note 18 : Événements relatifs aux catégories d'actions

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Fund ont commencé leurs activités le 24 février 2023 :

Global Opportunistic Bond Fund	IS1 (USD), ISH1 (EUR), ISH2 (GBP), WS1 (USD), WSH1 (EUR), WSH2 (GBP)
--------------------------------	--

La catégorie d'actions suivante de MFS Meridian Fund a commencé ses activités le 31 mars 2023 :

U.S. Total Return Bond Fund	IS1 (USD)
-----------------------------	-----------

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Funds ont commencé leurs activités le 24 avril 2023 :

Blended Research European Equity Fund	IF1 (EUR)
Continental European Equity Fund	IF1 (EUR), IF1 (GBP)
Euro Credit Fund	IF1 (EUR)
Global Credit Fund	IF1 (USD)
Global Equity Income Fund	IF1 (USD)
Global New Discovery Fund	IF1 (USD)
Global Strategic Equity Fund	IF1 (USD)

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Fund ont commencé leurs activités le 1^{er} août 2023 :

Global High Yield Fund	IS1 (USD), ISH1 (EUR), ISH2 (GBP)
------------------------	-----------------------------------

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Funds ont commencé leurs activités le 28 août 2023 :

Contrarian Value Fund	P1 (EUR)
European Research Fund	ISD1 (EUR)
Global High Yield Fund	IS2 (USD), WS1 (USD), WSH1 (EUR), WS2 (USD), WSH2 (EUR), WSH2 (GBP)
Global New Discovery Fund	P1 (EUR)
Global Opportunistic Bond Fund	IH1 (CHF), WS2 (USD), WSH2 (EUR)
Limited Maturity Fund	IH1 (EUR)

Le MFS Meridian Funds - Global Listed Infrastructure Fund a commencé ses activités le 13 septembre 2023.

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Funds ont été liquidées et fermées le 27 septembre 2023 :

Blended Research European Equity Fund	CH1 (USD)
Euro Credit Fund	A2 (EUR)

La catégorie d'actions suivante de MFS Meridian Fund a commencé ses activités le 16 novembre 2023 :

Contrarian Value Fund	IS1 (EUR)
-----------------------	-----------

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Funds ont été liquidées et fermées le 11 janvier 2024 :

Continental European Equity Fund	A1 (GBP)
Diversified Income Fund	AH2 (EUR), AH4 (EUR)
Emerging Markets Debt Fund	A1 (GBP), AH2 (EUR), WH2 (EUR), WH2 (GBP)
European Core Equity Fund	CH1 (USD)
European Research Fund	CH1 (USD), I3 (EUR)
European Smaller Companies Fund	CH1 (USD)
European Value Fund	A1 (GBP), WH1 (CHF)
Global Equity Fund	A1 (GBP)
Global Equity Income Fund	AH2 (EUR)
Global High Yield Fund	A2 (EUR), AH2 (EUR)
Global Opportunistic Bond Fund	AH2 (EUR), I2 (USD)
Global Total Return Fund	A1 (GBP), AH2 (EUR), AH4 (EUR)
Prudent Capital Fund	AH4 (EUR), WH1 (CHF)
U.K. Equity Fund	A1 (GBP), W2 (GBP)

Note 19 : Événements postérieurs

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Fund ont commencé leurs activités le 1^{er} février 2024 :

Euro Credit Fund	P1 (EUR)
European Value Fund	P1 (EUR)

Les catégories d'actions suivantes de MFS Meridian Funds ont commencé leurs activités le 28 mars 2024 :

Contrarian Value Fund	Z1 (JPY)
European Value Fund	WS1 (EUR)
Global High Yield Fund	ISH2 (EUR)

ADDENDA

FRAIS SUR ENCOURS (révisés)

Pour les douze mois clos le 31 janvier 2024 :

Le pourcentage des frais sur encours suivant a été calculé conformément à la directive de la Swiss Funds & Asset Management Association relative au calcul et à la publication du total des frais sur encours des organismes de placement collectif du 16 mai 2008 (version du 20 avril 2015).

Emerging Markets Debt Fund	
Catégorie Z1 (USD)	0,05 %

POLITIQUE DE RÉMUNÉRATION (non révisée)

La Société de Gestion a adopté une politique de rémunération et met en œuvre des procédures et pratiques connexes qui sont cohérentes avec une gestion saine et efficace des risques et qui promeuvent cette gestion d'une manière adaptée à sa taille, à son organisation interne, ainsi qu'à la nature, à la portée et à la complexité de ses activités. La politique de rémunération de la Société de Gestion est administrée et supervisée par un comité de rémunération composé de membres de la direction exécutive de MFS et de son département des ressources humaines et est examinée et approuvée chaque année par ce comité de rémunération et le Conseil d'administration de la Société de Gestion.

De plus amples informations sur la politique de rémunération, notamment une description de la méthode de calcul des rémunérations et bénéfices, sont disponibles sur le site meridian.mfs.com (sous le lien « Informations sur la politique de rémunération de MFS »). Une version papier de ces informations peut également être obtenue sur demande au siège social de la Société de Gestion, sans frais.

À la date de la clôture de l'exercice de la Société, le personnel identifié de la Société de gestion qui a effectué des activités relatives à la Société était composé de 69 membres, y compris les gestionnaires indépendants de la Société de Gestion et certains de leurs représentants. Le montant total de la rémunération payée par la Société de Gestion et ses représentants au personnel identifié relatif à la Société au cours de l'exercice fiscal de la Société s'élevait à 34 611 291 €, dont 2 405 801 € de rémunération fixe et 32 205 490 € de rémunération variable. Des informations sur la rémunération versée au cours de l'exercice au personnel identifié sont disponibles sur demande au siège social de la Société de Gestion sur présentation d'une raison valable d'obtention de telles informations.

Aucune rémunération versée par la Société de Gestion au cours de l'exercice de la Société n'a été versée directement par la Société ou un quelconque compartiment, ou n'a résulté de commissions de performance.

RÈGLEMENT RELATIF AUX OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES (non révisé)

Le Règlement relatif aux opérations de financement sur titres (Règlement (UE) 2015/2365) (« SFT ») exige la publication d'informations détaillées sur l'utilisation par la Société d'opérations de financement sur titres dans les rapports annuels et semestriels de la Société.

Conformément à l'article 31(11) du Règlement SFT, une opération de financement sur titres (« OFT ») est définie comme suit :

- une opération de mise en pension ;
- un prêt de titres ou de matières premières et un emprunt de titres ou de matières premières ;
- une opération d'achat-revente ou une opération de vente-rachat ;
- une opération de prêt avec appel de marge.

Le Règlement SFT étend également les exigences de publication aux swaps de rendement total.

Les exigences de publication sont présentées dans les tableaux ci-après. Pour de plus amples informations concernant le recours aux OFT et aux swaps de rendement total par les compartiments, veuillez vous reporter aux Notes aux états financiers suivantes :

- Accords de mise en pension : Note 2 et Note 12
- Titres prêtés : Note 4
- Swaps de rendement total : Note 2 et Note 14

Au 31 janvier 2024, les compartiments présentaient les montants suivants de titres prêtés par rapport au total des actifs prêtables :

Compartiment	Valeur de marché des Accords de mise en pension	Valeur de marché en % du total des actifs prêtables (a)
European Smaller Companies Fund	1 196 290 €	0,65 %
European Value Fund	38 953 394 €	1,28 %
U.S. Value Fund	633 180 \$	0,03 %

(a) Le total des actifs prêtables est défini comme les « Investissements à la valeur » aux Bilans à l'exclusion des liquidités et des quasi-liquidités.

Au 31 janvier 2024, les compartiments avaient engagé les montants suivants d'actifs dans chaque type d'OFT en pourcentage de l'actif net des compartiments :

Compartiment	Valeur de marché des titres prêtés	% de l'actif net	Valeur de marché des accords de mise en pension	% de l'actif net
	Règlement/Compensation pour chaque type d'OFT :	Bilatéral	Compensé	
Asia Ex-Japan Fund	— \$	0,00 %	702 449 \$	2,06 %
Contrarian Value Fund	— \$	0,00 %	55 456 704 \$	8,00 %
Diversified Income Fund	— \$	0,00 %	1 972 840 \$	2,71 %
Emerging Markets Debt Fund	— \$	0,00 %	169 666 783 \$	7,50 %
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	— \$	0,00 %	2 661 999 \$	9,34 %
Emerging Markets Equity Fund	— \$	0,00 %	1 280 771 \$	1,63 %
Emerging Markets Equity Research Fund	— \$	0,00 %	121 605 \$	4,36 %
European Smaller Companies Fund	1 196 290 €	0,65 %	— €	0,00 %
European Value Fund	38 953 394 €	1,28 %	— €	0,00 %
Global Credit Fund	— \$	0,00 %	2 927 490 \$	3,03 %
Global Equity Fund	— \$	0,00 %	11 119 871 \$	0,36 %
Global Equity Income Fund	— \$	0,00 %	206 516 \$	3,02 %
Global High Yield Fund	— \$	0,00 %	8 924 023 \$	3,80 %
Global Intrinsic Value Fund	— \$	0,00 %	1 193 497 \$	1,67 %
Global Listed Infrastructure Fund	— \$	0,00 %	81 157 \$	3,54 %
Global New Discovery Fund	— \$	0,00 %	343 509 \$	5,78 %
Global Opportunistic Bond Fund	— \$	0,00 %	13 711 012 \$	3,10 %
Global Research Focused Fund	— \$	0,00 %	1 594 658 \$	1,23 %
Global Strategic Equity Fund	— \$	0,00 %	77 440 \$	2,31 %
Global Total Return Fund	— \$	0,00 %	21 540 189 \$	1,44 %
Inflation-Adjusted Bond Fund	— \$	0,00 %	4 194 815 \$	3,20 %
Limited Maturity Fund	— \$	0,00 %	15 298 305 \$	1,36 %
Managed Wealth Fund	— \$	0,00 %	681 714 \$	4,88 %
Prudent Capital Fund	— \$	0,00 %	235 682 436 \$	7,01 %
Prudent Wealth Fund	— \$	0,00 %	194 329 143 \$	6,68 %
U.S. Concentrated Growth Fund	— \$	0,00 %	1 353 652 \$	0,29 %
U.S. Corporate Bond Fund	— \$	0,00 %	13 509 481 \$	2,31 %
U.S. Government Bond Fund	— \$	0,00 %	980 771 \$	0,28 %
U.S. Growth Fund	— \$	0,00 %	521 803 \$	0,92 %
U.S. Total Return Bond Fund	— \$	0,00 %	24 149 025 \$	2,69 %
U.S. Value Fund	633 180 \$	0,03 %	6 782 312 \$	0,37 %

Au 31 janvier 2024, les (jusqu'à) dix principaux émetteurs de garanties pour l'ensemble des OFT utilisés par les compartiments étaient les suivants :

Garantie des titres prêtés :

Émetteur de la garantie	Compartiment	Type	Qualité (Moody's)	Devise	Valeur
France	European Value Fund	Obligations	Aa2	USD	27 508 985 €
Allemagne	European Value Fund	Obligations	Aaa	USD	8 793 182 €
Pays-Bas	European Value Fund	Obligations	Aaa	USD	7 522 453 €
États-Unis	European Smaller Companies Fund	Obligations	Aaa	USD	1 324 864 €
États-Unis	U.S. Value Fund	Obligations	Aaa	USD	736 434 \$

Émetteur de la garantie :	Garantie des titres prêtés			
	États-Unis			
Compartment	Type	Devises	Qualité (Moody's)	Valeur
Asia Ex-Japan Fund	Obligations	USD	Aaa	716 608 \$
Contrarian Value Fund	Obligations	USD	Aaa	56 565 842 \$
Diversified Income Fund	Obligations	USD	Aaa	2 012 962 \$
Emerging Markets Debt Fund	Obligations	USD	Aaa	173 060 169 \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Obligations	USD	Aaa	2 715 324 \$
Emerging Markets Equity Fund	Obligations	USD	Aaa	1 306 442 \$
Emerging Markets Equity Research Fund	Obligations	USD	Aaa	124 047 \$
Global Credit Fund	Obligations	USD	Aaa	2 986 129 \$
Global Equity Fund	Obligations	USD	Aaa	11 342 280 \$
Global Equity Income Fund	Obligations	USD	Aaa	210 724 \$
Global High Yield Fund	Obligations	USD	Aaa	9 102 521 \$
Global Intrinsic Value Fund	Obligations	USD	Aaa	1 217 386 \$
Global Listed Infrastructure Fund	Obligations	USD	Aaa	82 853 \$
Global New Discovery Fund	Obligations	USD	Aaa	350 439 \$
Global Opportunistic Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	13 986 015 \$
Global Research Focused Fund	Obligations	USD	Aaa	1 626 582 \$
Global Strategic Equity Fund	Obligations	USD	Aaa	79 860 \$
Global Total Return Fund	Obligations	USD	Aaa	21 971 195 \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	4 278 776 \$
Limited Maturity Fund	Obligations	USD	Aaa	15 604 361 \$
Managed Wealth Fund	Obligations	USD	Aaa	695 456 \$
Prudent Capital Fund	Obligations	USD	Aaa	240 396 171 \$
Prudent Wealth Fund	Obligations	USD	Aaa	198 215 788 \$
U.S. Concentrated Growth Fund	Obligations	USD	Aaa	1 380 763 \$
U.S. Corporate Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	13 779 833 \$
U.S. Government Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	1 000 387 \$
U.S. Growth Fund	Obligations	USD	Aaa	537 458 \$
U.S. Total Return Bond Fund	Obligations	USD	Aaa	24 632 050 \$
U.S. Value Fund	Obligations	USD	Aaa	6 918 007 \$

Au 31 janvier 2024, les (jusqu'à) 10 principales contreparties de chaque type d'OFT étaient les suivantes :

OFT :	Titres prêtés	Accords de mise en pension
Contrepartie :	Goldman Sachs Agency Lending	State Street Bank & Trust Co.
Pays d'établissement :	États-Unis	États-Unis
Compartment		
Asia Ex-Japan Fund	— \$	702 449 \$
Contrarian Value Fund	— \$	55 456 704 \$
Diversified Income Fund	— \$	1 972 840 \$
Emerging Markets Debt Fund	— \$	169 666 783 \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	— \$	2 661 999 \$
Emerging Markets Equity Fund	— \$	1 280 771 \$
Emerging Markets Equity Research Fund	— \$	121 605 \$
European Smaller Companies Fund	1 196 290 €	— €
European Value Fund	38 953 394 €	— €
Global Credit Fund	— \$	2 927 490 \$
Global Equity Fund	— \$	11 119 871 \$

OFT :	Titres prêtés	Accords de mise en pension
Contrepartie :	Goldman Sachs Agency Lending	State Street Bank & Trust Co.
Pays d'établissement :	États-Unis	États-Unis
Compartiment		
Global Equity Income Fund	— \$	206 516 \$
Global High Yield Fund	— \$	8 924 023 \$
Global Intrinsic Value Fund	— \$	1 193 497 \$
Global Listed Infrastructure Fund	— \$	81 157 \$
Global New Discovery Fund	— \$	343 509 \$
Global Opportunistic Bond Fund	— \$	13 711 012 \$
Global Research Focused Fund	— \$	1 594 658 \$
Global Strategic Equity Fund	— \$	77 440 \$
Global Total Return Fund	— \$	21 540 189 \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	— \$	4 194 815 \$
Limited Maturity Fund	— \$	15 298 305 \$
Managed Wealth Fund	— \$	681 714 \$
Prudent Capital Fund	— \$	235 682 436 \$
Prudent Wealth Fund	— \$	194 329 143 \$
U.S. Concentrated Growth Fund	— \$	1 353 652 \$
U.S. Corporate Bond Fund	— \$	13 509 481 \$
U.S. Government Bond Fund	— \$	980 771 \$
U.S. Growth Fund	— \$	521 803 \$
U.S. Total Return Bond Fund	— \$	24 149 025 \$
U.S. Value Fund	633 180 \$	6 782 312 \$

Données cumulées relatives aux transactions pour chaque type d'OFT réparties en fonction de l'échéance de la garantie :

OFT :	Titres prêtés						
Compartiment	Moins de 1 jour	1 jour à 1 semaine	1 semaine à 1 mois	1 à 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Échéance ouverte
European Smaller Companies Fund	— €	— €	— €	— €	252 004 €	1 072 860 €	— €
European Value Fund	— €	— €	— €	— €	27 508 985 €	16 315 635 €	— €
U.S. Value Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$	736 434 \$	— \$

OFT :	Accords de mise en pension						
Compartiment	1 jour à 1 semaine	1 semaine à 1 mois	1 à 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Échéance ouverte	
Asia Ex-Japan Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	716 608 \$	— \$	
Contrarian Value Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	56 565 842 \$	— \$	
Diversified Income Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	2 012 962 \$	— \$	
Emerging Markets Debt Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	173 060 169 \$	— \$	
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	2 715 324 \$	— \$	
Emerging Markets Equity Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	1 306 442 \$	— \$	
Emerging Markets Equity Research Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	124 047 \$	— \$	
Global Credit Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	2 986 129 \$	— \$	
Global Equity Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	11 342 280 \$	— \$	
Global Equity Income Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	210 724 \$	— \$	
Global High Yield Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	9 102 521 \$	— \$	
Global Intrinsic Value Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	1 217 386 \$	— \$	
Global Listed Infrastructure Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	82 853 \$	— \$	
Global New Discovery Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	350 439 \$	— \$	
Global Opportunistic Bond Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	13 986 015 \$	— \$	
Global Research Focused Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	1 626 582 \$	— \$	
Global Strategic Equity Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	79 860 \$	— \$	

OFT :**Accords de mise en pension**

Compartiment	1 jour à 1 semaine	1 semaine à 1 mois	1 à 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Échéance ouverte
Global Total Return Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	21 971 195 \$	— \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	4 278 776 \$	— \$
Limited Maturity Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	15 604 361 \$	— \$
Managed Wealth Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	695 456 \$	— \$
Prudent Capital Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	240 396 171 \$	— \$
Prudent Wealth Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	198 215 788 \$	— \$
U.S. Concentrated Growth Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	1 380 763 \$	— \$
U.S. Corporate Bond Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	13 779 833 \$	— \$
U.S. Government Bond Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	1 000 387 \$	— \$
U.S. Growth Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	537 458 \$	— \$
U.S. Total Return Bond Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	24 632 050 \$	— \$
U.S. Value Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	6 918 007 \$	— \$

Données cumulées relatives aux transactions pour chaque type d'OFT réparties en fonction de l'échéance de l'OFT :

OFT :**Titres prêtés**

Compartiment	Moins de 1 jour	1 jour à 1 semaine	1 semaine à 1 mois	1 à 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Échéance ouverte
European Smaller Companies Fund	— €	— €	— €	— €	— €	— €	1 196 290 €
European Value Fund	— €	— €	— €	— €	— €	— €	38 953 394 €
U.S. Value Fund	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$	633 180 \$

OFT :**Accords de mise en pension**

Compartiment	Moins de 1 jour	1 jour à 1 semaine	1 semaine à 1 mois	1 à 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Échéance ouverte
Asia Ex-Japan Fund	— \$	702 449 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Contrarian Value Fund	— \$	55 456 704 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Diversified Income Fund	— \$	1 972 840 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Emerging Markets Debt Fund	— \$	169 666 783 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	— \$	2 661 999 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Emerging Markets Equity Fund	— \$	1 280 771 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Emerging Markets Equity Research Fund	— \$	121 605 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global Credit Fund	— \$	2 927 490 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global Equity Fund	— \$	11 119 871 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global Equity Income Fund	— \$	206 516 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global High Yield Fund	— \$	8 924 023 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global Intrinsic Value Fund	— \$	1 193 497 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global Listed Infrastructure Fund	— \$	81 157 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global New Discovery Fund	— \$	343 509 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global Opportunistic Bond Fund	— \$	13 711 012 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global Research Focused Fund	— \$	1 594 658 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global Strategic Equity Fund	— \$	77 440 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Global Total Return Fund	— \$	21 540 189 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	— \$	4 194 815 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Limited Maturity Fund	— \$	15 298 305 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Managed Wealth Fund	— \$	681 714 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Prudent Capital Fund	— \$	235 682 436 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
Prudent Wealth Fund	— \$	194 329 143 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
U.S. Concentrated Growth Fund	— \$	1 353 652 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$

OFT :**Accords de mise en pension**

Compartiment	Moins de 1 jour	1 jour à 1 semaine	1 semaine à 1 mois	1 à 3 mois	3 mois à 1 an	Plus de 1 an	Échéance ouverte
U.S. Corporate Bond Fund	— \$	13 509 481 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
U.S. Government Bond Fund	— \$	980 771 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
U.S. Growth Fund	— \$	521 803 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
U.S. Total Return Bond Fund	— \$	24 149 025 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$
U.S. Value Fund	— \$	6 782 312 \$	— \$	— \$	— \$	— \$	— \$

Part de la garantie reçue qui est réutilisée, par rapport au montant maximum spécifié dans le prospectus ou les informations transmises aux investisseurs :

Les compartiments ne sont pas autorisés à vendre, réinvestir ou donner en gage la garantie reçue sous la forme de titres. Dans la mesure où les compartiments reçoivent des liquidités en garantie, ladite garantie en liquidités ne serait placée en dépôt qu'auprès d'établissements de crédit autorisés en vertu du droit luxembourgeois, et, le cas échéant, ne peut être réinvestie que dans des obligations d'État de haute qualité, des opérations de vente-rachat (pourvu que les transactions soient soumises à une supervision prudentielle par des établissements de crédit et que le compartiment soit en mesure de rappeler à tout moment le montant intégral des liquidités comptabilisées) ou des fonds du marché monétaire à court terme autorisés en vertu du droit luxembourgeois afin d'atténuer le risque de pertes lié au réinvestissement. Les compartiments n'ont pas reçu de garantie en numéraire pour des OFT ou des swaps de rendement total au 31 janvier 2024.

Garde de la garantie reçue par les compartiments dans le cadre des OFT, nombre et noms des dépositaires (custodians) et montant des actifs de garantie gardés par chacun des dépositaires :

Compartiment	Nombre de Dépositaires	Dépositaire	
		State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
		Valeur de la garantie des titres prêtés	Valeur de la garantie des accords de mise en pension
Asia Ex-Japan Fund	1	— \$	716 608 \$
Contrarian Value Fund	1	— \$	56 565 842 \$
Diversified Income Fund	1	— \$	2 012 962 \$
Emerging Markets Debt Fund	1	— \$	173 060 169 \$
Emerging Markets Debt Local Currency Fund	1	— \$	2 715 324 \$
Emerging Markets Equity Fund	1	— \$	1 306 442 \$
Emerging Markets Equity Research Fund	1	— \$	124 047 \$
European Smaller Companies Fund	1	1 324 864 €	— €
European Value Fund	1	43 824 620 €	— €
Global Credit Fund	1	— \$	2 986 129 \$
Global Equity Fund	1	— \$	11 342 280 \$
Global Equity Income Fund	1	— \$	210 724 \$
Global High Yield Fund	1	— \$	9 102 521 \$
Global Intrinsic Value Fund	1	— \$	1 217 386 \$
Global Listed Infrastructure Fund	1	— \$	82 853 \$
Global New Discovery Fund	1	— \$	350 439 \$
Global Opportunistic Bond Fund	1	— \$	13 986 015 \$
Global Research Focused Fund	1	— \$	1 626 582 \$
Global Strategic Equity Fund	1	— \$	79 860 \$
Global Total Return Fund	1	— \$	21 971 195 \$
Inflation-Adjusted Bond Fund	1	— \$	4 278 776 \$
Limited Maturity Fund	1	— \$	15 604 361 \$
Managed Wealth Fund	1	— \$	695 456 \$
Prudent Capital Fund	1	— \$	240 396 171 \$
Prudent Wealth Fund	1	— \$	198 215 788 \$
U.S. Concentrated Growth Fund	1	— \$	1 380 763 \$
U.S. Corporate Bond Fund	1	— \$	13 779 833 \$
U.S. Government Bond Fund	1	— \$	1 000 387 \$

Compartiment	Nombre de Dépositaires	Dépositaire	
		State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch	State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch
		Valeur de la garantie des titres prêtés	Valeur de la garantie des accords de mise en pension
U.S. Growth Fund	1	— \$	537 458 \$
U.S. Total Return Bond Fund	1	— \$	24 632 050 \$
U.S. Value Fund	1	736 434 \$	6 918 007 \$

Garde de la garantie octroyée par le compartiment dans le cadre des OFT et des swaps de rendement total, proportion de la garantie détenue sur des compte séparés ou sur des comptes joints ou sur tout autre type de compte :

Au 31 janvier 2024, les compartiments n'ont pas donné en gage de garanties en lien avec les OFT ou les swaps de rendement total.

Données relatives au rendement et au coût pour chaque type d'OFT et de swap de rendement total décrit réparties entre le compartiment, le gestionnaire de l'organisme de placement collectif et les tierces parties (par exemple l'agent prêteur) en termes absolus et en pourcentage des rendements globaux générés par ce type d'OFT et de swap de rendement total :

Pour de plus amples informations concernant les revenus perçus et les frais encourus pour les accords de mise en pension, veuillez vous reporter à la Note 2. Pour les prêts de titres, veuillez vous reporter à la Note 4. Au 31 janvier 2024, les compartiments ne détenaient aucun swap de rendement total.



Ernst & Young

Société anonyme
35E, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

B.P. 780
L-2017 Luxembourg

Tel : +352 42 124 1
www.ey.com/luxembourg

R.C.S. Luxembourg B 47 771
TVA LU 16063074

À l'attention des actionnaires de
MFS Meridian Funds
4, rue Albert Borschette
L-1246 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Opinion

Nous avons procédé au contrôle des états financiers de MFS Meridian Funds (le « Fonds ») et de chacun de ses compartiments, lesquels comprennent les Bilans et les Tableaux des investissements au 31 janvier 2024, les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net pour l'exercice clos à cette date, ainsi que les Notes aux états financiers, qui comprennent une synthèse des règles et méthodes comptables importantes.

À notre avis, les états financiers ci-joints donnent une image sincère et fidèle de la situation financière du Fonds et de chacun de ses compartiments au 31 janvier 2024, ainsi que de leur résultat d'exploitation et des variations de leur actif net au cours de l'exercice clos à cette date, conformément aux exigences légales et réglementaires luxembourgeoises relatives à l'établissement et à la présentation des états financiers.

Éléments servant de base à notre opinion

Nous avons réalisé notre audit conformément à la loi du 23 juillet 2016 sur la profession de l'audit (la « Loi du 23 juillet 2016 ») et aux Normes internationales d'audit (« ISA ») telles qu'adoptées par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (« CSSF ») du Luxembourg. Les responsabilités qui nous incombent en vertu de la Loi du 23 juillet 2016 et des ISA adoptées au Luxembourg par la CSSF sont détaillées dans la section « Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé concernant l'audit des états financiers » de notre rapport. Nous sommes également indépendants vis-à-vis du Fonds conformément au Code international de déontologie des comptables professionnels (« Code IESBA »), y compris les Normes internationales d'indépendance, du Conseil des normes internationales de déontologie comptable, adopté au Luxembourg par la CSSF ainsi qu'avec les exigences éthiques qui s'appliquent à notre révision des états financiers, et nous avons rempli nos autres obligations déontologiques qui nous sont imposées en vertu de ces exigences. Nous estimons que les éléments probants recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Informations complémentaires

Le Conseil d'administration du Fonds est responsable des autres informations. Les autres informations englobent les informations publiées dans le rapport annuel, mais pas les états financiers et notre rapport.

Notre opinion concernant les états financiers ne couvre pas les autres informations et nous n'exprimons aucune forme de garantie à ce sujet.

Dans le cadre de notre audit des états financiers, nous avons pour obligation de lire les autres informations et, ce faisant, de déterminer si ces informations présentent des différences importantes avec les états financiers ou les connaissances acquises dans le cadre de l'audit ou si elles contiennent des erreurs importantes. Si les travaux que nous avons effectués nous amènent à conclure à l'existence d'une erreur importante dans ces autres informations, notre obligation est de la signaler. Nous n'avons rien de particulier à signaler en la matière.

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

Le Conseil d'administration du Fonds est responsable de l'établissement et de la présentation fidèle des présents états financiers, conformément aux exigences légales et réglementaires luxembourgeoises relatives à l'établissement et à la présentation des états financiers, ainsi que des contrôles internes qu'il estime nécessaires pour assurer l'établissement d'états financiers ne comportant pas d'anomalies significatives, qu'elles soient dues à une fraude ou à une erreur.

Dans le cadre de l'établissement des états financiers, le Conseil d'administration du Fonds est chargé d'évaluer la capacité du Fonds et de chacun de ses compartiments à poursuivre ses activités, en divulguant, le cas échéant, les éléments relatifs à la continuité d'exploitation et en appliquant le principe comptable de la continuité d'exploitation, sauf s'il prévoit de liquider le Fonds ou l'un de ses compartiments, ou de cesser ses activités, ou ne dispose d'aucune alternative réaliste que de le faire.

Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé concernant l'audit des états financiers

Notre objectif consiste à vérifier raisonnablement si les états financiers ne contiennent aucune anomalie importante, qu'elle soit due à une fraude ou à une erreur, et à élaborer un rapport qui comprend notre opinion. La garantie raisonnable est une garantie importante, mais pas la garantie qu'un audit réalisé conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux ISA, telles qu'adoptées au Luxembourg par la CSSF, permettra de toujours détecter une anomalie importante. Les anomalies importantes peuvent être dues à une fraude ou une erreur et sont considérées comme importantes si elles sont de nature à influencer, individuellement ou prises ensemble, sur les décisions financières prises par les utilisateurs sur la base de ces états financiers.

RAPPORT DU RÉVISEUR D'ENTREPRISES

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux ISA, telles qu'adoptées au Luxembourg par la CSSF, nous faisons valoir notre expertise et nous maintenons un scepticisme professionnel tout au long de l'audit. Nous sommes également amenés à :

- Détecter et évaluer les risques d'anomalie importante dans les états financiers, due à une fraude ou une erreur, concevoir et appliquer des procédures d'audit visant à répondre à ces risques, et obtenir des éléments probants suffisants et appropriés pour formuler une opinion. Le risque de ne pas détecter une anomalie importante due à une fraude est plus important que pour une anomalie due à une erreur, car la fraude peut comporter de la collusion, des omissions volontaires, de fausses déclarations, l'usage de faux ou le contournement des contrôles internes.
- Comprendre le mécanisme de contrôle interne s'appliquant à l'audit afin d'élaborer des procédures d'audit qui tiennent compte des circonstances, mais pas dans le but de formuler une opinion sur l'efficacité du contrôle interne du Fonds.
- Évaluer le caractère adéquat des normes comptables utilisées et le caractère raisonnable des estimations comptables et des informations associées publiées par le Conseil d'administration du Fonds.
- Formuler une opinion concernant le caractère adéquat de l'utilisation par le Conseil d'administration du Fonds du principe comptable de la continuité d'exploitation et, sur la base des éléments probants obtenus, l'existence ou non d'une incertitude importante concernant les événements ou les conditions à même de compromettre gravement la capacité du Fonds ou l'un de ses compartiments à poursuivre ses activités. Si nous mettons au jour une incertitude importante, nous avons l'obligation d'attirer l'attention dans notre rapport sur les informations correspondantes publiées dans les états financiers ou de revoir notre opinion si ces informations sont inadéquates. Nos conclusions sont fondées sur les éléments obtenus jusqu'à la date de notre rapport. Des événements ou conditions futurs peuvent toutefois contraindre le Fonds ou l'un quelconque de ses compartiments à cesser ses activités.
- Évaluer la présentation, la structure et le contenu généraux des états financiers, dont les informations publiées, et si les états financiers reflètent fidèlement les opérations et les événements sous-jacents.

Nous échangeons avec les personnes chargées de la gouvernance concernant, entre autres, le champ et la durée prévus de l'audit et les résultats importants, dont les failles importantes du contrôle interne que nous détectons durant notre audit.

Ernst & Young
Société anonyme
Cabinet de révision agréé

Kerry Nichol
Luxembourg, 17 mai 2024



Ernst & Young

Société anonyme
35E, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

B.P. 780
L-2017 Luxembourg

Tel : +352 42 124 1
www.ey.com/luxembourg

R.C.S. Luxembourg B 47 771
TVA LU 16063074

À l'attention des actionnaires de
MFS Meridian Funds
4, rue Albert Borschette
L-1246 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

Opinion

Nous avons procédé au contrôle des états financiers de MFS Meridian Funds (le « Fonds »), lesquels comprennent les Bilans et les Tableaux des investissements au 31 janvier 2024, les Comptes de profits et pertes et Tableaux de variation de l'actif net pour l'exercice clos à cette date, ainsi que les Notes aux états financiers (collectivement, les « états financiers »).

À notre avis, les états financiers ci-joints renvoient une image fidèle, à tous égards importants, de la situation financière de MFS Meridian Funds au 31 janvier 2024, de son résultat d'exploitation et des variations de son actif net pour l'exercice clos à cette date, conformément aux exigences légales et réglementaires luxembourgeoises.

Éléments servant de base à notre opinion

Nous avons réalisé notre mission de révision conformément aux normes d'audit généralement admises aux États-Unis (« GAAS »). Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces normes sont décrites en détail dans la section « Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé concernant l'audit des états financiers » de notre rapport. Nous sommes tenus d'être indépendants vis-à-vis du Fonds et de remplir nos autres obligations déontologiques conformément aux exigences éthiques pertinentes relatives à notre audit. Nous sommes d'avis que les preuves que nous avons obtenues sont suffisantes et appropriées pour servir de fondement à notre opinion.

Responsabilités du Conseil d'administration au titre des états financiers

Le Conseil d'administration est chargé de l'établissement et de la présentation fidèle des états financiers en conformité avec les exigences légales et réglementaires luxembourgeoises et de la conception, de la mise en place et du maintien de contrôles internes pour l'établissement et la présentation fidèle des états financiers qui ne contiennent aucune anomalie importante, due à une fraude ou à une erreur.

Lors de la préparation des états financiers, le Conseil d'administration est tenu d'évaluer si des conditions ou événements, dans leur ensemble, soulèvent un doute important sur la capacité du Fonds à poursuivre ses activités pendant un an à compter de la date à laquelle les états financiers sont disponibles pour publication.

Responsabilités du Réviseur concernant l'audit des états financiers

Notre objectif consiste à vérifier raisonnablement si les états financiers ne contiennent aucune anomalie importante, qu'elle soit due à une fraude ou à une erreur, et à élaborer un rapport du réviseur qui comprend notre opinion. La garantie raisonnable est une garantie importante, mais pas absolue. Elle ne garantit donc pas qu'un audit réalisé conformément aux GAAS permettra de toujours détecter une anomalie importante, le cas échéant. Le risque de ne pas détecter une anomalie importante due à une fraude est plus important que pour une anomalie due à une erreur, car la fraude peut comporter de la collusion, des omissions volontaires, de fausses déclarations, l'usage de faux ou le contournement des contrôles internes. Les anomalies sont considérées comme importantes s'il existe une forte probabilité qu'elles influencent, individuellement ou collectivement, l'avis d'un utilisateur raisonnable basé sur les états financiers.

En procédant à un audit conformément aux GAAS, nous :

- Faisons valoir notre expertise et maintenons un scepticisme professionnel tout au long de l'audit.
- Détectons et évaluons les risques d'anomalie importante dans les états financiers, due à une fraude ou une erreur, et concevons et appliquons des procédures d'audit visant à répondre à ces risques. Ces procédures comprennent l'examen, par sondages, des éléments probants relatifs aux montants et aux chiffres présentés dans les états financiers.
- Comprendons le mécanisme de contrôle interne s'appliquant à l'audit afin d'élaborer des procédures d'audit qui tiennent compte des circonstances, mais pas dans le but de formuler une opinion sur l'efficacité du contrôle interne du Fonds. En ce sens, aucune opinion n'est exprimée à ce sujet.
- Évaluons la pertinence des règles et méthodes comptables utilisées et du caractère raisonnable des estimations comptables importantes produites par le Conseil d'administration, et évaluons également la présentation générale des états financiers.
- Déterminons si, selon nous, des conditions ou événements, dans leur ensemble, soulèvent un doute important sur la capacité du Fonds à poursuivre ses activités pendant une période raisonnable.

Nous avons l'obligation d'échanger avec les personnes chargées de la gouvernance concernant, entre autres, le champ et la durée prévus de l'audit, les résultats importants et certains éléments relatifs au contrôle interne que nous détectons durant notre audit.

RAPPORT DU RÉVISEUR D'ENTREPRISES

Autres informations

Le Conseil d'administration est responsable des autres informations. Les autres informations comprennent la lettre du Président, le Tableau des performances, les Informations générales, la Gouvernance d'entreprise, la Communication de certaines informations sur la gestion du risque, les Statistiques, l'Addenda, les réclamations ou questions des Actionnaires et les publications d'informations/Annexes en lien avec le SFDR mais n'incluent pas les états financiers et le rapport de notre auditeur y afférent. Notre opinion concernant les états financiers ne couvre pas les autres informations et nous n'exprimons aucune opinion ou forme de garantie à ce sujet.

Dans le cadre de notre audit des états financiers, nous avons pour obligation de lire les autres informations et de déterminer si celles-ci présentent des différences importantes avec les états financiers, ou si elles contiennent des erreurs importantes. Si, sur la base du travail effectué, nous concluons qu'il existe une anomalie importante non corrigée des autres informations, nous sommes tenus de la décrire dans notre rapport.

Ernst & Young S.A.

A handwritten signature in black ink that reads "Ernst & Young S.A." in a cursive, stylized font.

Luxembourg

17 mai 2024

ADMINISTRATEURS ET ADMINISTRATION

SOCIÉTÉ DE GESTION

MFS Investment Management Company (Lux) S.à r.l.
4, rue Albert Borschette
L-1246 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

CONSEIL D'ADMINISTRATION

Mitchell Freestone (Présidence) (a)

Conseiller Général Senior
MFS international (U.K.) Limited

Lina M. Medeiros (Présidence) (b)

Directrice de bureau
MFS Investment Management Company (Lux) S.à r.l.

Amrit Kanwal

Directeur financier
Massachusetts Financial Services Company

James R. Julian, Jr.

Directeur général
University of Massachusetts Foundation
Administrateur indépendant

Madeline Forrester

Administrateur Délégué Senior
Massachusetts Financial Services Company

Thomas A. Bogart

Administrateur indépendant

SIÈGE SOCIAL

4, rue Albert Borschette
L-1246 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg
R.C.S. Luxembourg B 39346

GESTIONNAIRE FINANCIER

Massachusetts Financial Services Company
111 Huntington Avenue
Boston, Massachusetts 02199 États-Unis

DÉPOSITAIRE, ADMINISTRATION, TENEUR DE REGISTRE ET AGENT DE TRANSFERT

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

RÉVISEUR D'ENTREPRISES

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

CONSEILLER JURIDIQUE

Arendt & Medernach
41A, Avenue J.F. Kennedy
L-2082 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

(a) Nommé président le 1^{er} mars 2024.

(b) À compter du 1^{er} mars 2024, Lina M. Medeiros a quitté son poste de membre du conseil d'administration de MFS Meridian Funds.



PRINCIPAUX AGENTS LOCAUX

Autriche	Raiffeisen Bank International AG, Am Stadtpark 9, A-1030 Vienne, Autriche. Tél. : +43-1-71-707-1730
Belgique	CACEIS Belgium SA/NV, Avenue du Port/Havenlaan, 86C b 320, B-1000 Bruxelles. Tél. : +32 2 209 2600
Danemark	Nordea Danmark, Filial af Nordea Bank Abp, Finland, Issuer Services, Securities Services, Hermes Hus, Helgeshøj Allé 33, Høje Taastrup, DK-2630 Taastrup, Danemark. Tél. : +45 33 33 33 33
France	State Street Bank International GmbH, Paris Branch, Cœur Défense - Tour A, 100, Esplanade du général de Gaulle, 92931 Paris la Défense Cedex, France. Tél. : +33 1 44 45 44 16
Allemagne	Marcard Stein & Co., Ballindamm 36, 20095 Hambourg, Allemagne. Tél. : +49-40-32-099-224
Hong Kong	State Street Trust (HK) Limited, 68th Floor, Two International Finance Centre, 8 Finance Street, Central, Hong Kong. Tél. : +852 2840 5388
Irlande	Bridge Consulting Limited, Ferry House, 48-53 Mount Street Lower, Dublin 2, D02 PT98, Irlande. Tél. : +353 (0)1-566-9800
Italie	AllFunds Bank S.A., via Bocchetto, 6 - 20123 Milan. Tél. : +39 02 3211 7001 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A. (BBVA) – (succursale italienne), Corso Giacomo Matteotti 10, 20121 Milan, Italie BNP Paribas Securities Services, succursale de Milan, via Ansperto n° 5, 20123 Milan, Italie CACEIS Bank, succursale italienne, siège social : 89-91 rue Gabriel Peri - 92120 Montrouge, France Tél. : +39 02 721 74 411 et siège opérationnel : Piazza Cavour 2, 20121, Milan, Italie. Tél. : +39 02 721 74 423 Société Générale Securities Services, S.p.A., via Benigno Crespi, 19/A-MAC 2, 20159, Milan, Italie. Tél. : +39-02-9178-4588 State Street Bank International GmbH - Succursale Italia, Via Ferrante Aporti, 10, 20125 Milan, Italie. Tél. : +39-02-3211-7001/7002, Fax : +39 02 3211 7935
Luxembourg	State Street Bank International GmbH, succursale luxembourgeoise, 49, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg. Tél. : +352-46-40-10-600
Pays-Bas	Société Générale Securities Services, S.p.A., Via Benigno Crespi, 19/A-MAC 2, 20159, Milan, Italie. Tél. : +39 029178.4588
Suède	Securities Services, Skandinaviska Enskilda Banken AB, Global Funds, RA 6, Rissneleden 110, SE-106 40 Stockholm, Suède. Tél. : +46-8763-6906/5960
Suisse	Représentant et Agent payeur : REYL & Cie S.A. (anciennement Carnegie Fund Services S.A.), 4, rue du Rhône, 1204 Genève, Suisse. Tél. : +41-22-816-8000
Royaume-Uni	Correspondant centralisateur : MFS International (U.K.) Ltd., One Carter Lane, Londres, Royaume-Uni EC4V 5ER. Tél. : +44 (0) 20 7429 7200
Taiwan	Agent Principal : PineBridge Investments Management Taiwan Limited, 10th Floor, 144 Min Chuan East Road. Section 2 Taipei, Taïwan 10436. Tél : +886-2-2516-7883

Suisse Représentant : REYL & Cie S.A., 4, rue du Rhône, 1204 Genève, Suisse, www.reyl.com
Service de paiement : REYL & Cie S.A., 4, rue du Rhône, 1204 Genève, Suisse

Le prospectus et les feuilles d'information de base pour la Suisse, les statuts, les rapports annuel et semestriel de MFS Meridian Funds, en français, ainsi que la liste des achats et des ventes effectués par le fonds durant l'exercice comptable, peuvent être obtenus, sur simple demande et gratuitement, au siège du représentant en Suisse : REYL & Cie S.A., 4, rue du Rhône, 1204 Genève, Suisse.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Blended Research European Equity Fund (« MFS Blended Research European Equity Fund »)

Identifiant d'entité juridique : 54930067ZHQOV0SGFJ15

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



No



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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables



ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

À compter du 22 novembre 2022, le MFS Blended Research European Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Blended Research European Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 93,10 % des titres de participation du portefeuille du MFS Blended Research European Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 91,91 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,71 % de l'actif du MFS Blended Research European Equity Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	82,44	81,38
31 janvier 2023	70,46	70,20
31 octobre 2022	69,51	69,01

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	74,59	73,64
31 janvier 2023	62,73	62,50
31 octobre 2022	63,81	63,36

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
31 octobre 2022	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	93,10	91,91
31 janvier 2023	87,33	87,01
31 octobre 2022	87,33	86,71

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Blended Research European Equity Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Blended Research European Equity Fund.

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.



Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
ASML Holding NV	Technologies de l'information	3,85	Pays-Bas
Nestle SA	Biens de consommation courante	3,83	Suisse
Roche Holding AG	Soins de santé	3,21	Suisse
Novartis AG	Soins de santé	3,18	Suisse
TotalEnergies SE	Énergie	2,62	France
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	2,61	France
Schneider Electric SE	Industrie	2,23	France
Novo Nordisk AS	Soins de santé	1,99	Danemark
Iberdrola SA	Services publics	1,98	Espagne
UBS Group AG	Finance	1,97	Suisse
BNP Paribas SA	Finance	1,95	France
Rio Tinto PLC	Matériaux	1,87	Royaume-Uni
Eni SpA	Énergie	1,85	Italie
Zurich Insurance Group AG	Finance	1,81	Suisse
British American Tobacco PLC	Biens de consommation courante	1,74	Royaume-Uni

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



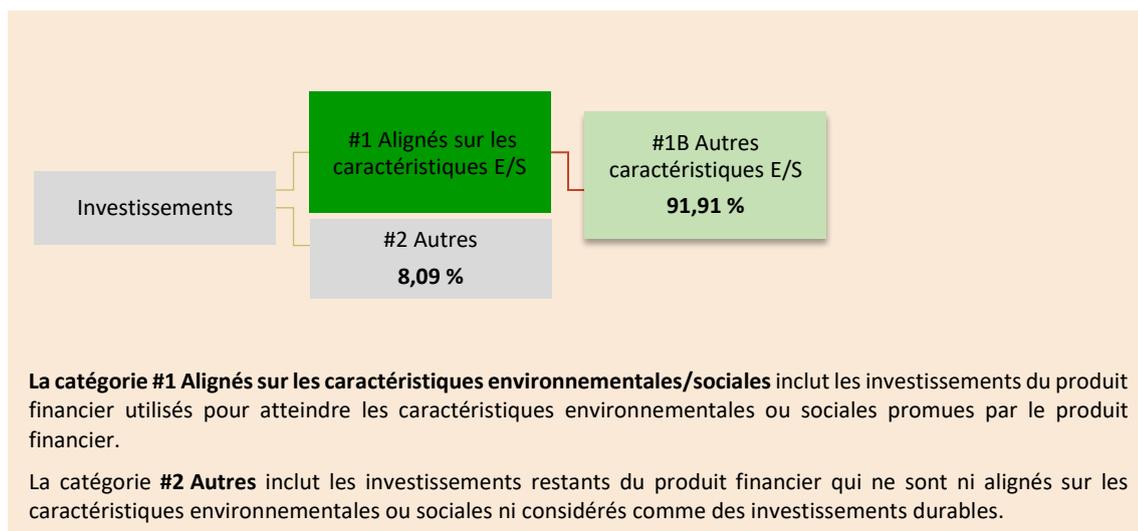
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Blended Research European Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Blended Research European Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 98,71 % de l'actif total du portefeuille du MFS Blended Research European Equity Fund ; les investissements restants (1,29 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 93,10 % des titres de participation du portefeuille du MFS Blended Research European Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 91,91 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 8,09 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Secteurs	Pondération moyenne en %
Finance	16,35
Soins de santé	15,02
Industrie	14,85
Biens de consommation discrétionnaire	12,07
Biens de consommation courante	11,70
Technologies de l'information	7,42
Énergie	6,39
Matériaux	6,14
Services publics	4,50
Services de communication	3,28
Immobilier	1,38
Liquidités et instruments assimilés	0,77
Autre	-0,11

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Blended Research European Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui :

Dans le gaz fossile

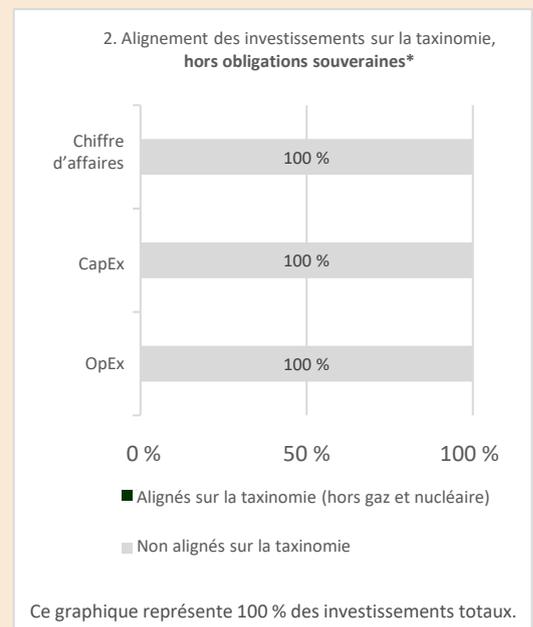
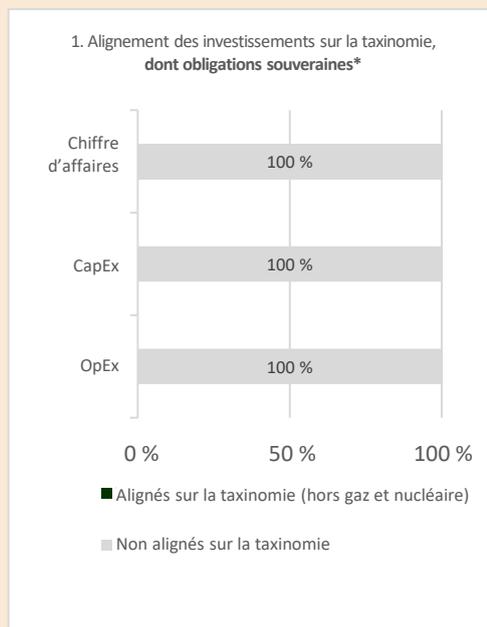
Dans l'énergie nucléaire



Non. Le MFS Blended Research European Equity Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Blended Research European Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



● sont 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 de la taxinomie de l'UE.



Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
31 octobre 2022	0 %	0 %	0 %



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Blended Research European Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Blended Research European Equity Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Blended Research European Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 8 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Erste Group, GEA Group, Glencore, Iberdrola, Rolls Royce Holdings PLC et Schneider Electric. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Schneider Electric SE, Shell Plc, UBS Group AG et TotalEnergies SE. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Glencore Plc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Shell Plc, Glencore Plc et TotalEnergies SE.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Continental European Equity Fund (« **MFS Continental European Equity Fund** »)

Identifiant d'entité juridique : GY33BV78RICKYR2RFZ08

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

À compter du 31 décembre 2021, le MFS Continental European Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Continental European Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs de titres de participation qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 97,58 % des titres de participation du portefeuille du MFS Continental European Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 93,70 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 96,02 % de l'actif du MFS Continental European Equity Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	93,86	90,12
31 janvier 2023	80,26	78,10
30 novembre 2021	75,14	73,56

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	90,58	86,97
31 janvier 2023	77,42	75,33
30 novembre 2021	72,70	71,19

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	97,58	93,70
31 janvier 2023	92,67	90,17
30 novembre 2021	90,79	88,88

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Continental European Equity Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

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.

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Continental European Equity Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Schneider Electric SE	Industrie	6,55	France
Nestle SA	Biens de consommation courante	6,38	Suisse
SAP SE	Technologies de l'information	5,99	Allemagne
Roche Holding AG	Soins de santé	5,64	Suisse
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	5,29	France
Linde PLC	Matériaux	5,14	États-Unis
Novartis AG	Soins de santé	4,83	Suisse
Capgemini SE	Technologies de l'information	4,36	France
EssilorLuxottica SA	Soins de santé	3,25	France
Amadeus IT Group SA	Biens de consommation discrétionnaire	2,93	Espagne

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 10 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



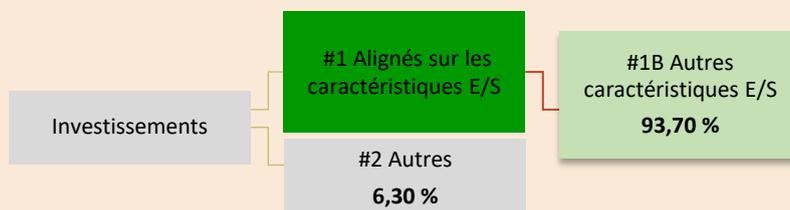
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Continental European Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Continental European Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 96,02 % de l'actif total du portefeuille du MFS Continental European Equity Fund ; les investissements restants (3,98 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 97,58 % des titres de participation du portefeuille du MFS Continental European Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 93,70 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 6,30 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Soins de santé	21,08
Biens de consommation courante	14,51
Biens de consommation discrétionnaire	13,69
Technologies de l'information	13,53
Industrie	13,51
Finance	12,56
Matériaux	7,25
Services de communication	2,43
Énergie	2,10
Services publics	0,55
Liquidités et instruments assimilés	-1,93

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

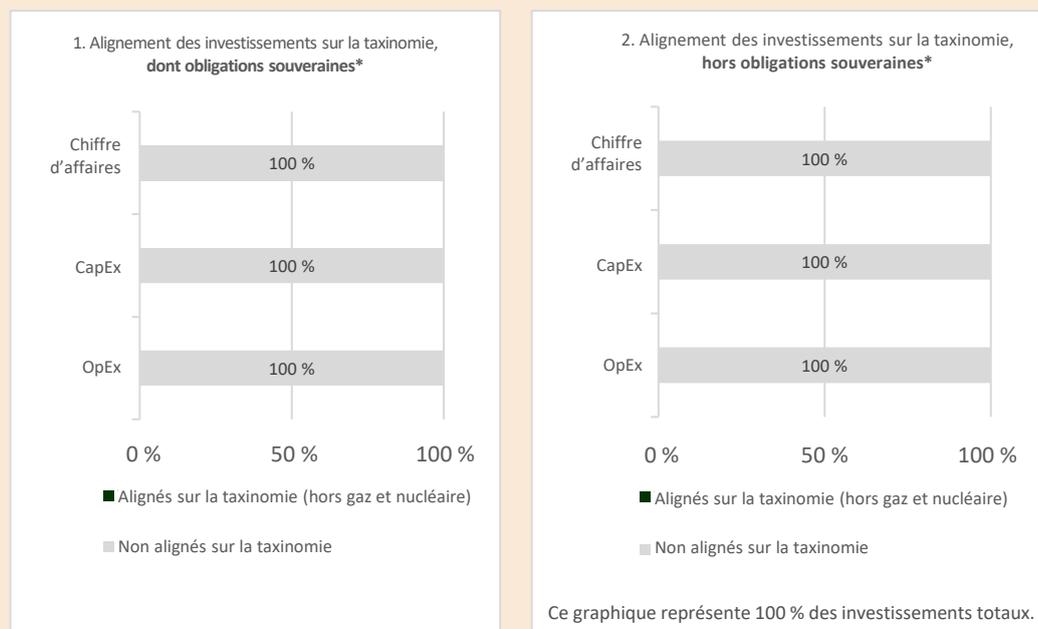
Zéro. Le MFS Continental European Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Continental European Equity Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Continental European Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Continental European Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Continental European Equity Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Continental European Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 4 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Erste Group, GEA Group, Sika AG et Schneider Electric. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique et les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Schneider Electric SE.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Contrarian Value Fund (« MFS Contrarian Value Fund »)
Identifiant d'entité juridique : 549300MK0DQR28Y1H769

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



À compter du 31 décembre 2021, le MFS Contrarian Value Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Contrarian Value Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 96,75 % des titres de participation du portefeuille du MFS Contrarian Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 88,40 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 91,37 % de l'actif du MFS Contrarian Value Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	86,58	79,11
31 janvier 2023	60,45	57,04
30 novembre 2021	63,88	60,44

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	77,37	70,69
31 janvier 2023	72,79	68,68
30 novembre 2021	56,70	53,62

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	96,75	88,40
31 janvier 2023	94,01	88,70
30 novembre 2021	81,29	76,91

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Contrarian Value Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Contrarian Value Fund.

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.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Next PLC	Biens de consommation discrétionnaire	5,08	Royaume-Uni
Danone SA	Biens de consommation courante	3,63	France
Cie Générale des Établissements Michelin SCA	Biens de consommation discrétionnaire	3,57	France
Novozymes AS	Matériaux	3,50	Danemark
Autoliv Inc	Biens de consommation discrétionnaire	3,40	États-Unis
Signify NV	Industrie	3,26	Pays-Bas
ArcelorMittal	Matériaux	3,21	France
CSX Corp	Industrie	3,19	États-Unis
Cenovus Energy Inc	Énergie	3,12	Canada
Ryanair Holdings PLC ADR	Industrie	3,04	Irlande
Anglo American PLC	Matériaux	2,79	Royaume-Uni
Weir Group PLC	Industrie	2,76	Royaume-Uni
Fortum OYJ	Services publics	2,73	Finlande
Sage Group PLC/The	Technologies de l'information	2,68	Royaume-Uni
Medtronic PLC	Soins de santé	2,58	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



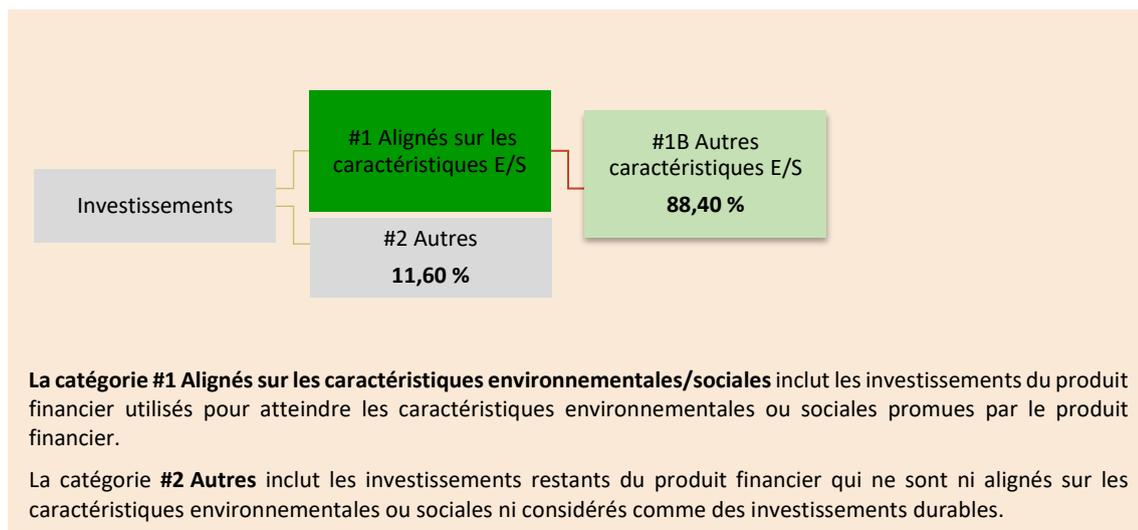
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Contrarian Value Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Contrarian Value Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 91,37 % de l'actif total du portefeuille du MFS Contrarian Value Fund ; les investissements restants (8,63 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 96,75 % des titres de participation du portefeuille du MFS Contrarian Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 88,40 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 11,60 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.



Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Industrie	22,89
Finance	16,55
Biens de consommation discrétionnaire	16,54
Matériaux	11,71
Services publics	7,56
Technologies de l'information	5,08
Liquidités et instruments assimilés	4,71
Biens de consommation courante	3,63
Soins de santé	3,59
Énergie	3,12
Services de communication	2,84
Autre	0,01

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Contrarian Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?**

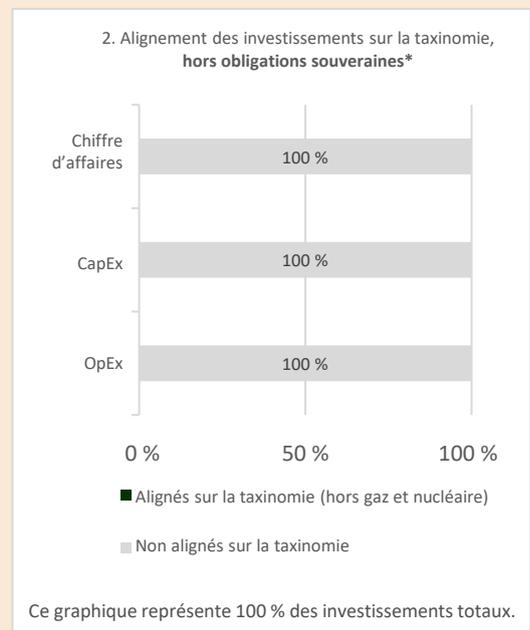
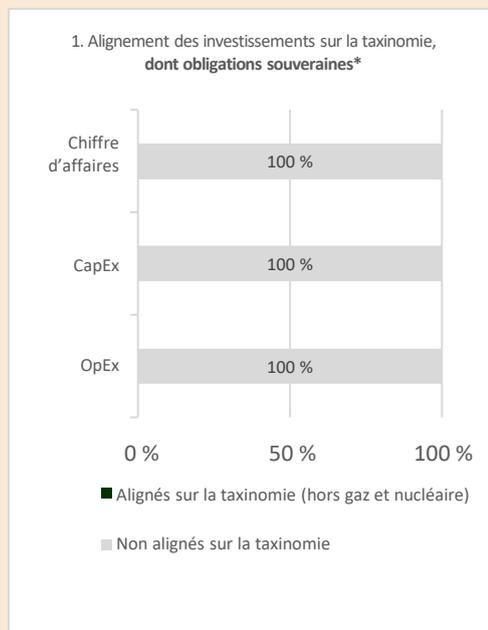
Oui :

Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire



Non. Le MFS Contrarian Value Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Contrarian Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %



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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Contrarian Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Contrarian Value Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Contrarian Value Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 5 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : ArcelorMittal, Bank of America Corp, National Grid PLC et Samsung Electronics Co Ltd. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat des émetteurs suivants au cours de la période sous revue : Bank of America Corporation et Citigroup Inc.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Diversified Income Fund (« MFS Diversified Income Fund »)
Identifiant d'entité juridique : 549300Y5OY3W3PCL65

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-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 : _____ %

No

Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



À compter du 30 novembre 2022, le MFS Diversified Income Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Diversified Income Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation et au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille (selon le cas) dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des quatre critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 76,93 % des titres de participation du portefeuille du MFS Diversified Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 23 % de l'actif total ; 58,69 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Diversified Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 23,68 % de l'actif total. Les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 29,90 % et 40,35 % de l'actif du MFS Diversified Income Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à

des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les **indicateurs de durabilité** mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation et de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de participation et de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	66,65	19,93
31 janvier 2023	49,86	15,41
31 octobre 2022	60,65	18,71

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	51,50	20,78
31 janvier 2023	54,02	21,43
31 octobre 2022	54,28	22,30

Critère climatique 2 – mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	52,48	15,69
31 janvier 2023	55,09	17,03
31 octobre 2022	54,57	16,83

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	20,89	8,43
31 janvier 2023	16,31	6,47
30 novembre 2022	17,19	7,19

Critère climatique 3 – mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2022	0	0

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2022	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	1,78	0,72
31 janvier 2023	2,14	0,85
30 novembre 2022	2,33	0,96

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	76,93	23,00
31 janvier 2023	66,56	20,57
30 novembre 2022	71,60	22,08

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2, 3 et/ou 4) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	58,69	23,68
31 janvier 2023	61,13	24,25
30 novembre 2022	62,39	25,63

... et par rapport aux périodes précédentes ?

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Diversified Income Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

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.

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Diversified Income Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
ProLogis, REIT	Immobilier	1,24	États-Unis
Equinix Inc, REIT	Immobilier	1,18	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 28 mars 24	Emprunts d'État américains	0,69	États-Unis
Obligation du Trésor américain, T 2 1/4, 15 août 27	Emprunts d'État américains	0,68	États-Unis
Sun Communities Inc, REIT	Immobilier	0,68	États-Unis
Extra Space Storage Inc, REIT	Immobilier	0,65	États-Unis
AvalonBay Communities Inc, REIT	Immobilier	0,64	États-Unis
Equity LifeStyle Properties Inc, REIT	Immobilier	0,61	États-Unis
Essex Property Trust Inc. REIT	Immobilier	0,61	États-Unis
Brixmor Property Group Inc, REIT	Immobilier	0,58	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 20 septembre 23	Emprunts d'État américains	0,57	États-Unis
Rio Tinto PLC	Matériaux	0,57	Royaume-Uni
Bon du Trésor américain, 2,875 %, 31 juillet 25	Emprunts d'État américains	0,57	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,75 %, 15 août 32	Emprunts d'État américains	0,56	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	0,54	Suisse

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Diversified Income Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation et 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Diversified Income Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 29,90 % et 40,35 % de l'actif total du portefeuille du MFS Diversified Income Fund ; les investissements restants (29,75 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 76,93 % des titres de participation du portefeuille du MFS Diversified Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 23,00 % de l'actif total du portefeuille ; 58,69 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Diversified Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 23,68 % de l'actif total du portefeuille ; 46,68 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 53,32 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Créances d'entreprises	35,69
Marchés émergents	15,27
Immobilier	11,67
Emprunts d'État américains	10,23
Titres adossés à des créances hypothécaires	7,84
Soins de santé	3,91
Biens de consommation courante	2,94
Finance	2,92
Liquidités et instruments assimilés	1,77
Énergie	1,74

Technologies de l'information	1,63
Matériaux	1,45
Services de communication	1,44
Industrie	1,27
Biens de consommation discrétionnaire	0,88
Services publics	0,71
Obligations titrisées (CDO)	0,62
Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	0,50
Hors marché américain	0,31
Obligations municipales	0,25
Titres adossés à des actifs	0,23
Obligations convertibles	0,06
Options sur indices	-0,03
Autre	-3,09

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Diversified Income Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

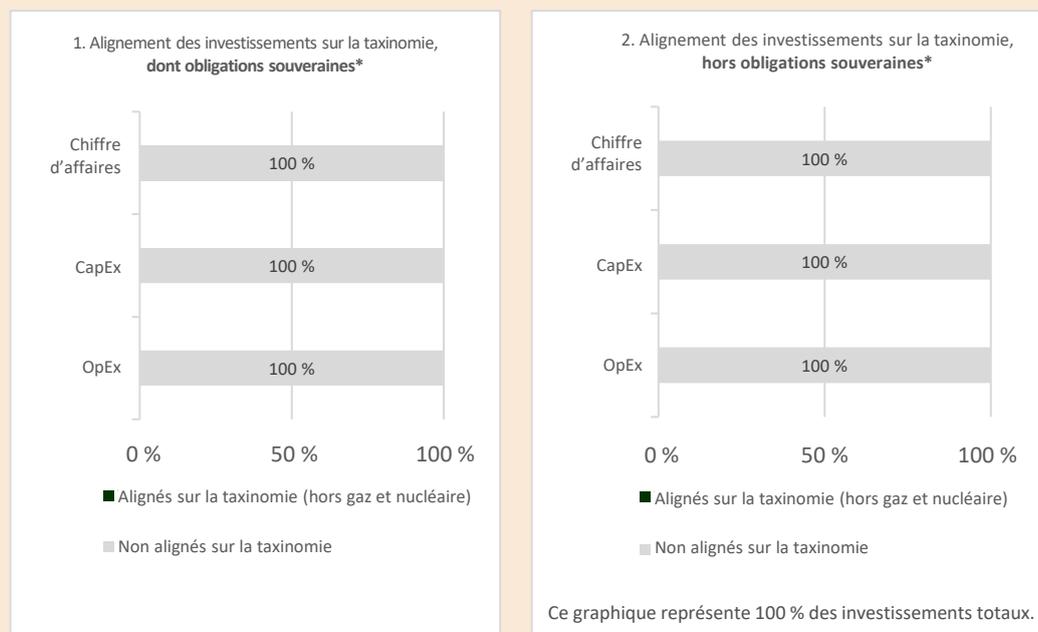
Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Diversified Income Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Diversified Income Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS Diversified Income Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

 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 de la taxinomie de l'UE.





Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation et les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Diversified Income Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Diversified Income Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 28 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : APA Group, Bank of America Corp, Becton Dickinson & Co, Diageo PLC, Duke Energy Corp, Edison International, Enel S.p.A., Erste Group Bank AG, Glencore PLC, Iberdrola SA, Omnicom Group Inc, Plains All American Pipeline LP, ProLogis REIT, Rayonier Inc REIT, Samsung Electronics Co Ltd, Sasol Ltd, Saudi Arabian Oil Co, Southern Co, Suncor Energy Inc, Thermo Fisher Scientific Inc, Toronto-Dominion Bank, Valero Energy Corp, Volkswagen AG, Vulcan Materials Co et Westinghouse Air Brake Technologies Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque physique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : TotalEnergies SE. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Glencore Plc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Coterra Energy Inc, Texas Roadhouse, Inc. et Exxon Mobil Corporation. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Suncor Energy Inc., Valero Energy Corporation, The Hartford Financial Services Group, Inc, Glencore Plc, Total Energies SE, Comcast Corporation, Exxon Mobil Corporation et Microsoft Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Euro Credit Fund (« MFS Euro Credit Fund »)
Identifiant d'entité juridique : 549300DZGNNNNMSY602

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Euro Credit Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Euro Credit Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 78,79 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Euro Credit Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 68,57 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 87,03 % de l'actif du MFS Euro Credit Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	61,93	53,90
31 janvier 2023	57,53	41,73
30 novembre 2021	56,13	48,72

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	50,23	43,72
31 janvier 2023	49,91	36,20
30 novembre 2021	44,04	38,23

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	6,73	5,86
31 janvier 2023	8,18	5,93
30 novembre 2021	6,92	6,0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).



Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	78,79	68,57
31 janvier 2023	79,06	57,34
30 novembre 2022	76,48	66,39

... et par rapport aux périodes précédentes ?

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

S/O.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Euro Credit Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



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 ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Euro Credit Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Euro Schatz, contrat à terme standardisé à 2 ans, 07 septembre 23	Produits dérivés	3,62	Allemagne
Itraxx Europe Série 39, receveur, 75,00, 19 juillet 23	Produits dérivés	2,84	Allemagne
Euro Schatz, contrat à terme standardisé à 2 ans, 07 décembre 23	Produits dérivés	2,41	Allemagne
Itraxx Europe Crossover Série 40, receveur, 350,00, 15 mai 24	Produits dérivés	2,37	Allemagne
Euro Schatz, contrat à terme standardisé à 2 ans, 07 mars 24	Produits dérivés	2,04	Allemagne
Banque Royale du Canada, RegS 0,625 %, 10 septembre 25	Entreprise	1,66	Canada
Bons du Trésor fédéral allemand, RegS 2,2 %, 12 décembre 24	Gouvernement	1,45	Allemagne
Itraxx Europe Crossover Série 40, receveur, 300,00, 15 mai 24	Produits dérivés	1,39	Allemagne
Province de l'Ontario, Canada, RegS 0,625 %, 17 avril 25	Gouvernement	1,31	Canada
Orange SA, RegS 3,625 % 16 novembre 31	Entreprise	1,19	France
Svenska Handelsbanken AB, RegS 3,375 %, 17 février 28	Entreprise	1,10	Suède
Euro Bund, contrat à terme standardisé à 10 ans, 07 septembre 23	Produits dérivés	1,09	Allemagne
APA Infrastructure Ltd, RegS 2,5 %, 15 mars 36	Entreprise	1,07	Australie
NBN Co Ltd, RegS 4,375 %, 15 mars 33	Gouvernement	1,07	Australie
Ubisoft Entertainment SA, RegS 0,878 %, 24 novembre 27	Entreprise	1,05	France

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

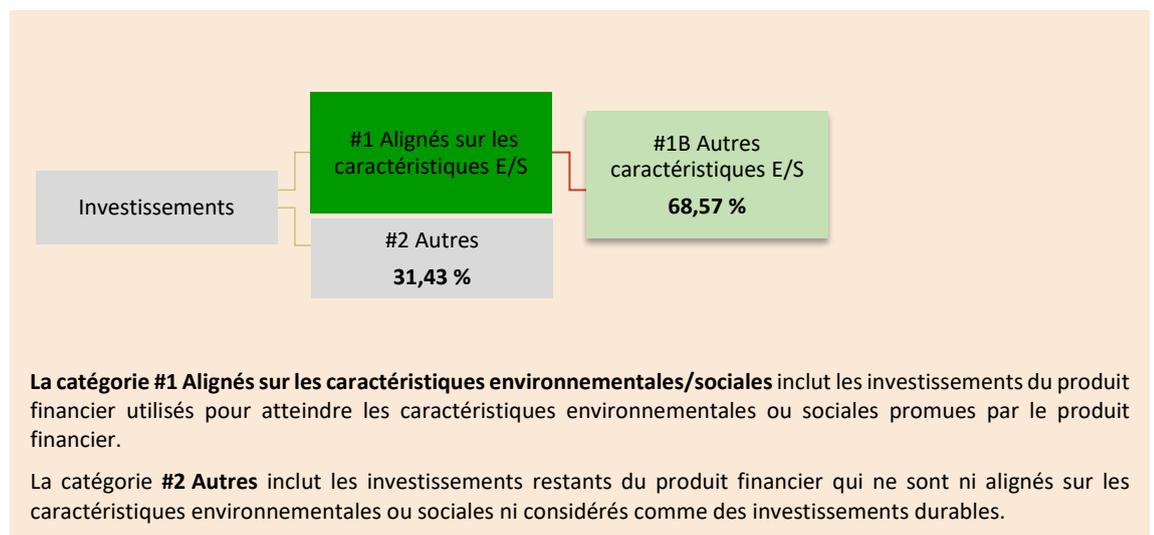
Le MFS Euro Credit Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Euro Credit Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs

décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 87,03 % de l'actif total du portefeuille du MFS Euro Credit Fund ; les investissements restants (12,97 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés. Au 31 janvier 2023, 78,79 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Euro Credit Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 68,57 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 31,43 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Sociétés privées – établissements financiers	40,10
Sociétés privées – industrie	34,84
Sociétés privées – services publics	10,05
Gouvernement – agences gouvernementales	7,11
Produits dérivés – négociés en bourse	6,61
Liquidités – Liquidités	3,02
Trésor – bons du Trésor	2,60
Gouvernement – organismes supranationaux liés à un gouvernement	2,49
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	1,81
Titrisation – titres couverts	1,24
Gouvernement – titres souverains liés à un État	0,66
Titrisation – titres adossés à des actifs	0,20
Produits dérivés – de gré à gré	-2,59

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Euro Credit Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?**

Oui :

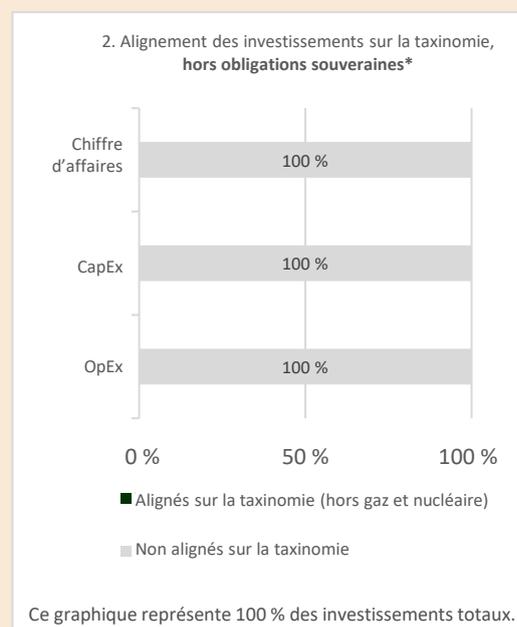
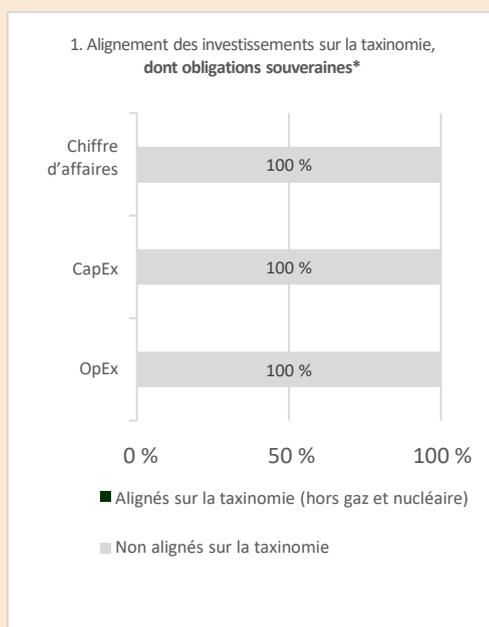
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Euro Credit Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Euro Credit Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS Euro Credit Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

S/O.

● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Concernant les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de liquidités et d'instruments assimilés.

● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le MFS Euro Credit Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

 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 de la taxinomie de l'UE.



Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements - MFS Euro Credit Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 14 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : APA Group, Duke Energy Corp, E.ON. SE, Enel S.p.A., Engie SA, Erste Group, Glencore PLC, National Grid PLC, RAC Bond, Thermo Fisher Scientific Inc, Toronto-Dominion Bank et Volkswagen AG. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque physique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales 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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – European Core Equity Fund (« MFS European Core Equity Fund »)

Identifiant d'entité juridique : 6Y75067IIDSWFOENA317

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-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 : _____ %

No

Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

À compter du 31 décembre 2021, le MFS European Core Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS European Core Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 90,85 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Core Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 90,40 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,50 % de l'actif du MFS European Core Equity Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	76,56	76,19
31 janvier 2023	65,35	64,58
30 novembre 2021	66,92	66,17

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	80,03	79,64
31 janvier 2023	71,72	70,88
30 novembre 2021	68,00	67,26

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	90,85	90,40
31 janvier 2023	85,52	84,52
30 novembre 2021	87,20	86,22



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veuillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

- **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS European Core Equity Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS European Core Equity Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Niveaux 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « Indicateurs d'émissions supplémentaires »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les

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.

critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	3,88	France
Schneider Electric SE	Industrie	3,76	France
Linde PLC	Matériaux	3,55	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	3,05	Suisse
Merck KGaA	Soins de santé	2,81	Allemagne
Diageo PLC	Biens de consommation courante	2,64	Royaume-Uni
Pernod Ricard SA	Biens de consommation courante	2,62	France
Heineken Holding NV	Biens de consommation courante	2,56	Pays-Bas
Cie Financière Richemont SA	Biens de consommation discrétionnaire	2,54	Suisse
Nestlé SA	Biens de consommation courante	2,47	Suisse
Novo Nordisk AS	Soins de santé	2,27	Danemark
Erste Group Bank AG	Finance	1,95	Autriche
UBS Group AG	Finance	1,93	Suisse
Legrand SA	Industrie	1,88	France
Air Liquide SA	Matériaux	1,81	France



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

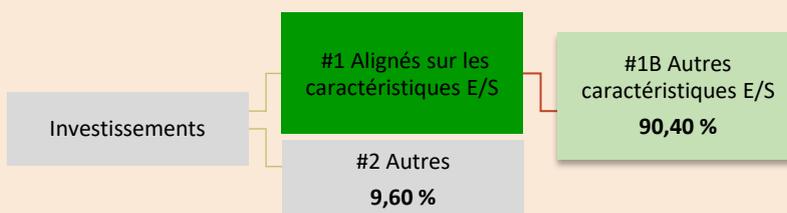


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS European Core Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS European Core Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 99,50 % de l'actif total du portefeuille du MFS European Core Equity Fund ; les investissements restants du portefeuille (0,50 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 90,85 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Core Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 90,40 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 9,60 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie #1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales 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.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Secteurs	Pondération moyenne en %
Industrie	17,13
Biens de consommation courante	16,72
Finance	16,60
Biens de consommation discrétionnaire	16,02
Soins de santé	13,26
Matériaux	9,81
Services de communication	3,89
Immobilier	3,01
Technologies de l'information	2,45
Liquidités et instruments assimilés	0,95
Warrants sur actions	0,05
Autre	-0,04

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



● **Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

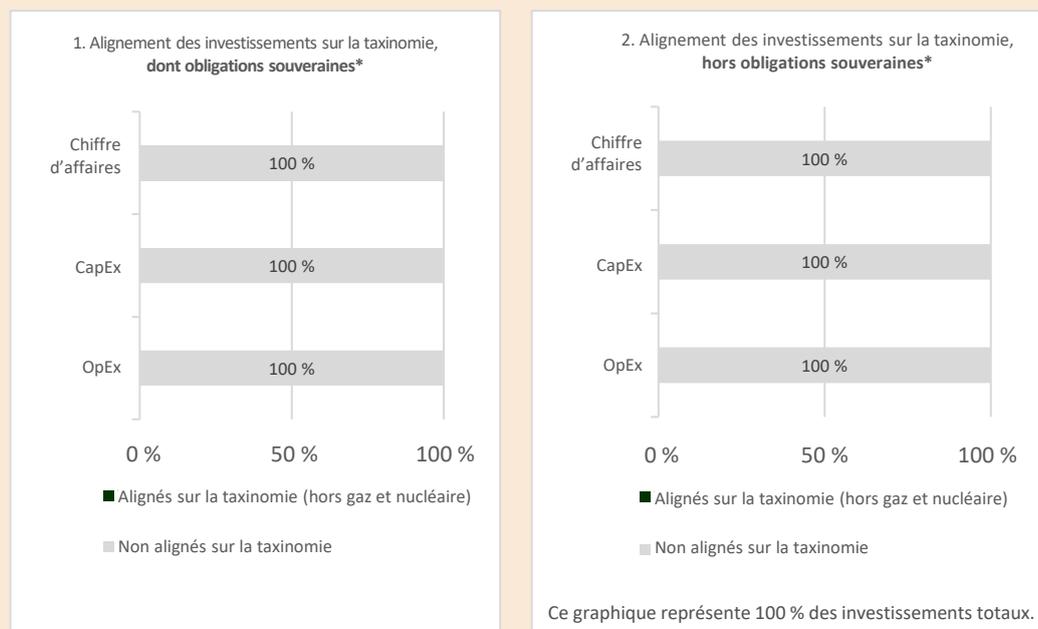
Zéro. Le MFS European Core Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?**

Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS European Core Equity Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS European Core Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS European Core Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

 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 de la taxinomie de l'UE.





Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS European Core Equity Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS European Core Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 5 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Diageo PLC, Erste Group, GEA Group, Rolls-Royce Holdings PLC et Schneider Electric SE. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Aena S.M.E. SA, Schneider Electric SE et UBS Group AG.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – European Research Fund (« MFS European Research Fund »)
Identifiant d'entité juridique : S9K235E4P9KO3JXU6G54

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS European Research Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS European Research Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 96,75 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Research Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 94,82 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,00 % de l'actif du MFS European Research Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité

mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	85,89	84,18
31 janvier 2023	65,87	64,84
30 novembre 2021	60,91	60,43

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	84,47	82,79
31 janvier 2023	66,02	64,98
30 novembre 2021	68,20	67,71

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	96,75	94,82
31 janvier 2023	87,20	85,84
30 novembre 2021	86,71	86,03



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veuillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

- **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS European Research Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

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.

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS European Research Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions

supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Nestle SA	Biens de consommation courante	4,37	Suisse
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	4,08	France
Roche Holding AG	Soins de santé	3,49	Suisse
Schneider Electric SE	Industrie	3,10	France
ASML Holding NV	Technologies de l'information	3,08	Pays-Bas
Linde PLC	Matériaux	3,02	États-Unis
TotalEnergies SE	Énergie	2,43	France
Wolters Kluwer NV	Industrie	2,35	Pays-Bas
Diageo PLC	Biens de consommation courante	2,22	Royaume-Uni
BNP Paribas SA	Finance	2,04	France
British American Tobacco PLC	Biens de consommation courante	1,85	Royaume-Uni
Iberdrola SA	Services publics	1,84	Espagne
Experian PLC	Industrie	1,79	Royaume-Uni
Cie Financière Richemont SA	Biens de consommation discrétionnaire	1,74	Suisse
Novartis AG	Soins de santé	1,74	Suisse

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

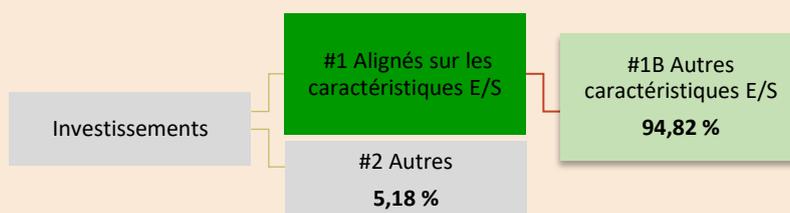


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS European Research Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS European Research Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 98,00 % de l'actif total du portefeuille du MFS European Research Fund ; les investissements restants (2,00 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 96,75 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Research Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 94,82 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 5,18 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie #1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales 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.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Secteurs	Pondération moyenne en %
Finance	17,61
Biens de consommation discrétionnaire	14,48
Industrie	13,44
Soins de santé	11,56
Biens de consommation courante	11,53
Matériaux	7,47
Énergie	6,04
Services publics	5,54
Technologies de l'information	5,18
Services de communication	4,33
Liquidités et instruments assimilés	1,62
Immobilier	0,74
Warrants sur actions	0,07
Autre	-0,07

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



● **Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

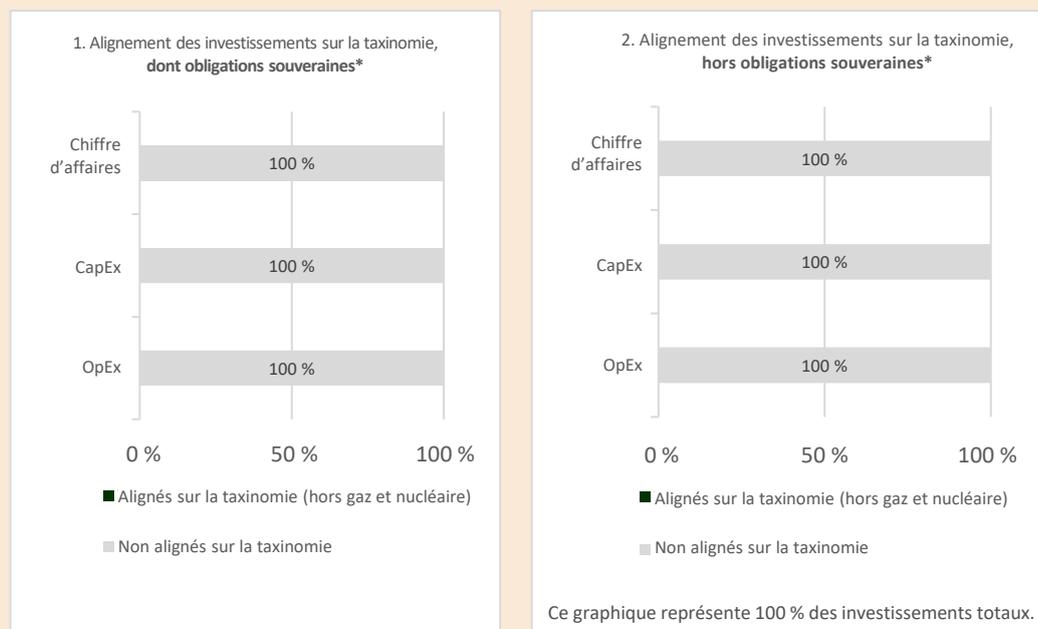
Zéro. Le MFS European Research Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE ?**

Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS European Research Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS European Research Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %



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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS European Research Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS European Research Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS European Research Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 10 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Diageo PLC, E.ON SE, GEA Group, Glencore PLC, Iberdrola SA, National Grid PLC, Rolls-Royce Holdings PLC et Schneider Electric SE. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : UBS Group AG, Schneider Electric SE et TotalEnergies SE. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Glencore Plc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Danske Bank A/S, Glencore Plc et TotalEnergies SE.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – European Smaller Companies Fund (« MFS European Smaller Companies Fund »)

Identifiant d'entité juridique : VOCTT9HXYER2M74L6515

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-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** :

_____ %

No

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

À compter du 31 décembre 2021, le MFS European Smaller Companies Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS European Smaller Companies Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 87,13 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Smaller Companies Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 86,27 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,01 % de l'actif du MFS European Smaller Companies Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les **indicateurs de durabilité** mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	76,12	75,37
31 janvier 2023	49,08	45,41
30 novembre 2021	52,85	50,03

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	63,25	62,63
31 janvier 2023	57,31	53,03
30 novembre 2021	46,70	44,20

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	87,13	86,27
31 janvier 2023	75,56	69,91
30 novembre 2021	69,43	65,72



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veuillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

- **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

- **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS European Smaller Companies Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS European Smaller Companies Fund.

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.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Cranswick PLC	Biens de consommation courante	4,81	Royaume-Uni
Symrise AG	Matériaux	4,32	Allemagne
Breedon Group PLC	Matériaux	3,43	Royaume-Uni
Sodexo SA	Biens de consommation discrétionnaire	3,21	France
Gerresheimer AG	Soins de santé	2,97	Allemagne
Cembre SpA	Industrie	2,96	Italie
Croda International PLC	Matériaux	2,34	Royaume-Uni
Carlsberg AS	Biens de consommation courante	2,20	Danemark
Galp Energia SGPS SA	Énergie	2,14	Portugal
Forterra PLC	Matériaux	2,07	Royaume-Uni
Italgas SpA	Services publics	2,06	Italie

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Compass Group PLC	Biens de consommation discrétionnaire	2,01	Royaume-Uni
GEA Group AG	Industrie	1,88	Allemagne
RS GROUP PLC	Industrie	1,79	Royaume-Uni
Legrand SA	Industrie	1,78	France

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



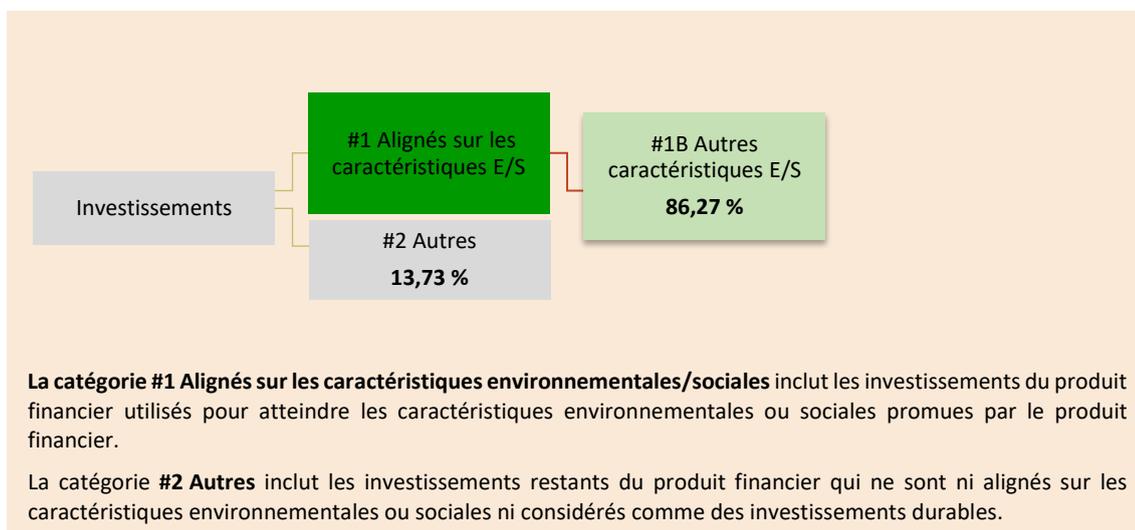
L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS European Smaller Companies Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS European Smaller Companies Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 99,01 % de l'actif total du portefeuille du MFS European Smaller Companies Fund ; les investissements restants (0,99 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 87,13 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Smaller Companies Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 86,27 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 13,73 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Matériaux	22,58
Industrie	20,50
Biens de consommation courante	13,66
Biens de consommation discrétionnaire	11,09
Soins de santé	9,12
Services de communication	5,28
Finance	4,72
Technologies de l'information	3,17
Immobilier	2,98
Énergie	2,85
Services publics	2,06
Liquidités et instruments assimilés	1,11
Autre	-0,06

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



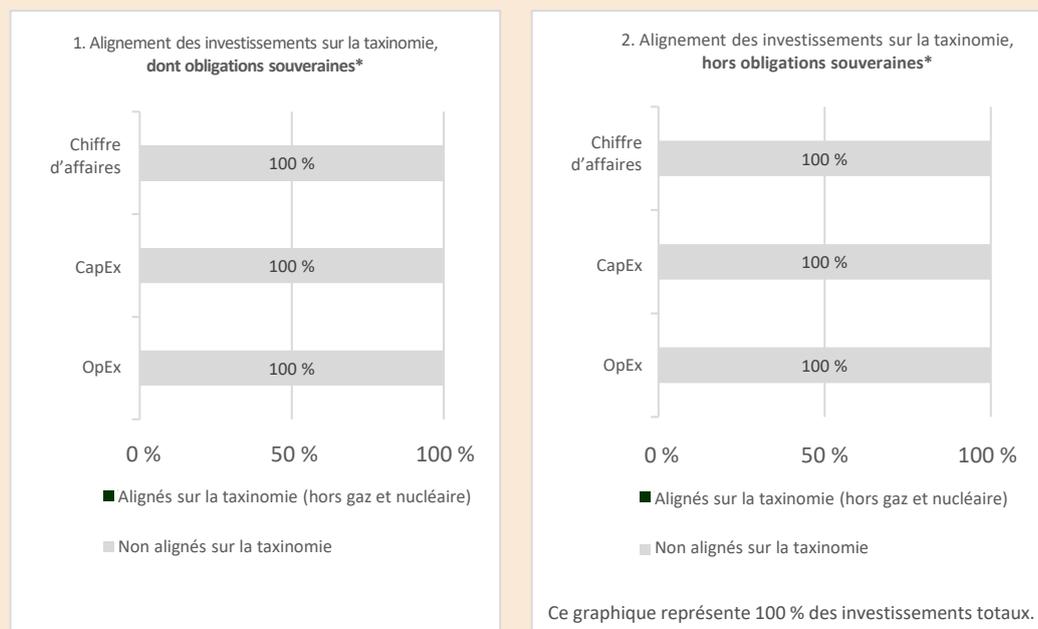
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS European Smaller Companies Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non. Le MFS European Smaller Companies Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS European Smaller Companies Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS European Smaller Companies Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS European Smaller Companies Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS European Smaller Companies Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 2 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Forterra PLC, GEA Group. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Corticeira Amorim SGPS SA.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – European Value Fund (« MFS European Value Fund »)
Identifiant d'entité juridique : FOW0N0ZBCI2YVLH77334

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

À compter du 31 décembre 2021, le MFS European Value Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS European Value Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 98,10 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 95,07 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 96,90 % de l'actif du MFS European Value Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	88,66	85,91
31 janvier 2023	66,20	64,28
30 novembre 2021	67,00	66,07

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	88,09	85,37
31 janvier 2023	81,02	78,68
30 novembre 2021	72,60	71,63

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	98,10	95,07
31 janvier 2023	93,32	90,62
30 novembre 2021	87,30	86,09



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS European Value Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS European Value Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Nestle SA	Biens de consommation courante	4,37	Suisse
Roche Holding AG	Soins de santé	3,64	Suisse
Iberdrola SA	Services publics	3,01	Espagne
Amadeus IT Group SA	Biens de consommation discrétionnaire	2,84	Espagne
Cie Financière Richemont SA	Biens de consommation discrétionnaire	2,81	Suisse
Safran SA	Industrie	2,72	France
Diageo PLC	Biens de consommation courante	2,69	Royaume-Uni
Schneider Electric SE	Industrie	2,64	France
Heineken NV	Biens de consommation courante	2,38	Pays-Bas
Cellnex Telecom SA	Services de communication	2,28	Espagne
Zurich Insurance Group AG	Finance	2,25	Suisse
Symrise AG	Matériaux	2,23	Allemagne
Infineon Technologies AG	Technologies de l'information	2,17	Allemagne
UBS Group AG	Finance	2,17	Suisse
Sanofi	Soins de santé	2,06	France

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

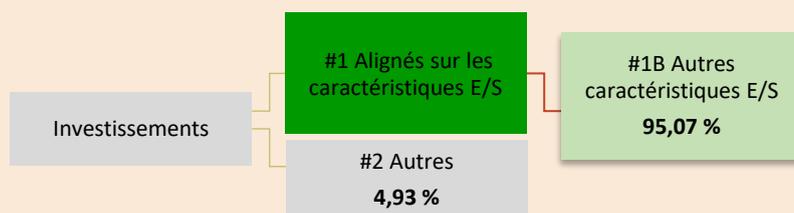


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS European Value Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS European Value Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 96,90 % de l'actif total du portefeuille du MFS European Value Fund ; les investissements restants (3,10 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 98,10 % des titres de participation du portefeuille du MFS European Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 95,07 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 4,93 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie #1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales 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.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Secteurs	Pondération moyenne en %
Industrie	20,46
Finance	17,24
Biens de consommation courante	16,18
Biens de consommation discrétionnaire	12,34
Soins de santé	10,44
Technologies de l'information	6,72
Services publics	5,88
Matériaux	5,48
Services de communication	2,51
Immobilier	1,07
Liquidités et instruments assimilés	0,92
Énergie	0,43
Warrants sur actions	0,10
Autre	-0,01

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

● **Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS European Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?**

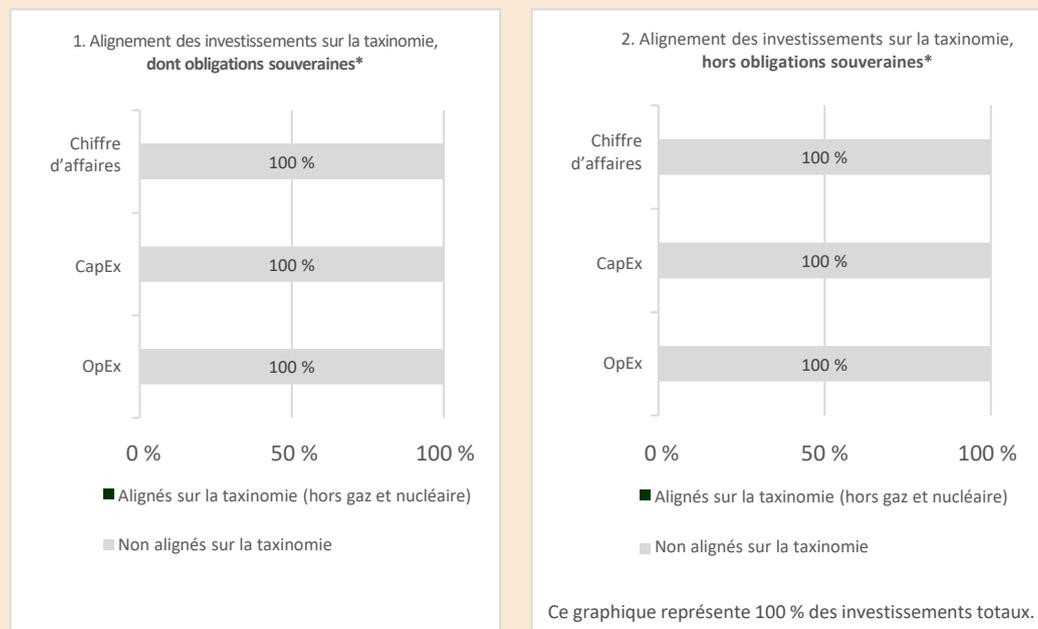
Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS European Value Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :
 - du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
 - des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
 - des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS European Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS European Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

S/O.

 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 de la taxinomie de l'UE.





Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS European Value Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration – MFS European Value Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 7 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Diageo PLC, E.ON SE, Erste Group, GEA Group, Iberdrola SA, National Grid PLC et Schneider Electric SE. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Schneider Electric SE et UBS Group AG.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Emerging Markets Debt Fund (« **MFS Emerging Markets Debt Fund** »)

Identifiant d'entité juridique : FNI86HINZ84YDDP4YD82

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



À compter du 28 août 2023, le MFS Emerging Markets Debt Fund a promu la caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign et la caractéristique MFS Low Carbon Transition grâce auxquelles MFS a évalué les émetteurs de titres de créance d'État et liés aux États (« émetteurs de titres de créance souverains ») et les émetteurs de titres de créance d'entreprises (le cas échéant) au regard des indicateurs ou critères de la caractéristique applicable. En particulier, le MFS Emerging Markets Debt Fund détiendra au moins 50 % des titres de créance souverains et d'entreprises combinés du portefeuille (les « Actifs éligibles ») investis dans : des émetteurs de titres de créance souverains qui répondent à au moins un des cinq indicateurs de la caractéristique MFS Emerging Markets Debt ; et/ou des émetteurs de titres de créance d'entreprises qui répondent à au moins un des quatre critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Au 31 janvier 2024, 84,05 % des Actifs éligibles du portefeuille du MFS Emerging Markets Debt Fund répondaient à au moins un des indicateurs ou critères climatiques, ce qui représentait 76,14 % de l'actif total (dont 63,78 % étaient des titres de créance souverains et 12,36 % étaient des titres de créance d'entreprises). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les informations périodiques ci-dessous couvrent la période allant du 28 août 2023 au 31 janvier 2024 et concernent la caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign ou la caractéristique MFS Low Carbon Transition (les « Caractéristiques MFS »).

Caractéristiques MFS	% des Actifs éligibles du portefeuille répondant aux Caractéristiques MFS	% de l'actif total du portefeuille répondant aux Caractéristiques MFS
31 janvier 2024	84,05	76,14

Les informations périodiques ci-dessous couvrent la période allant du 28 août 2023 au 31 janvier 2024 et concernent la caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign. Veuillez noter que les émetteurs privés détenus à 100 % par une entité souveraine sont considérés comme des actifs admissibles à l'examen au titre de cette caractéristique.

Indicateur national du Pilier éducation du Legatum Prosperity Index™ (le « Pilier éducation de Legatum ») – pourcentage (%) de titres de créance souverains du portefeuille émis par des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après). L'indice Legatum Prosperity Index™ est la propriété de Legatum Institute Limited.

Indicateur Éducation de Legatum	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	59,72	54,10

Indicateur national du Pilier santé du Legatum Prosperity Index™ (l'« Indicateur santé de Legatum ») – pourcentage (%) de titres de créance souverains du portefeuille émis par des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après). L'indice Legatum Prosperity Index™ est la propriété de Legatum Institute Limited.

Indicateur santé de Legatum	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	39,64	35,91

Score moyen en matière de corruption (Indicateur des principales incidences négatives 21), fondé sur l'indicateur de Contrôle de la corruption issu des Indicateurs de gouvernance mondiale (« WGI ») de la Banque mondiale – pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Indicateur de Contrôle de la corruption du WGI	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	26,47	23,98

Score moyen en matière de stabilité politique (Indicateur des principales incidences négatives 23) fondé sur l'indicateur de Stabilité politique et d'Absence de violence/terrorisme du WGI – pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Indicateur de Stabilité politique et d'Absence de violence/terrorisme du WGI	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	45,95	41,63

Score moyen en matière d'État de droit (Indicateur des principales incidences négatives 24) fondé sur l'indicateur de l'État de droit du WGI – pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Indicateur de l'État de droit du WGI	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	37,10	33,79

Conformité aux indicateurs – mesure du pourcentage (%) de titres de créance souverains du portefeuille qui respectaient au moins l'un des cinq indicateurs ci-dessus tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Indicateurs MFS Emerging Markets Sovereign	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à l'un des indicateurs	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des indicateurs
31 janvier 2024	70,40	63,78

Les informations périodiques ci-dessous couvrent la période allant du 28 août 2023 au 31 janvier 2024 et concernent la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	9,99	9,05

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	3,52	3,19

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	3,39	3,07

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2, 3 et/ou 4) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	13,64	12,36

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Emerging Markets Debt Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



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 ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Emerging Markets Debt Fund.

La caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign intègre les indicateurs suivants des principales incidences négatives en matière de gouvernance applicables aux émetteurs souverains :

- Score moyen en matière de corruption ;
- Score moyen en matière de stabilité politique ;
- Score moyen en matière d'état de droit.

Le Critère climatique 1 de la caractéristique MFS Low Carbon Transition est mesuré à l'aide des indicateurs des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants :

- émissions de GES (Niveaux 1 et 2 et, le cas échéant, 3) ;
- Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements

Afin de compléter la promotion de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, MFS met à la disposition des professionnels de l'investissement de MFS les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants :

- empreinte carbone ;
- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles ;
- part de la consommation d'énergie non renouvelable ;
- intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique ;
- (collectivement, les « Indicateurs d'émissions supplémentaires »).

MFS communique également les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants :

- violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales ;
- mixité au sein des organes de gouvernance

Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles. Des informations sur la façon dont les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable (ESG) ont été examinées seront communiquées dans le rapport annuel.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 28 août 2023 au 31 janvier 2024.

négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 28 août 2023 au 31 janvier 2024.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Obligation internationale du gouvernement omanais, RegS 7 %, 25 janvier 51	Titres liés à un État	1,37	Oman
Obligation internationale du gouvernement omanais, RegS 6,75 %, 17 janvier 48	Titres liés à un État	1,35	Oman
Bon du Trésor américain, 2,5 %, 15 février 46	Bons du Trésor	1,08	États-Unis
Obligation internationale du gouvernement dominicain, RegS 4,875 %, 23 septembre 32	Titres liés à un État	1,06	République dominicaine
Obligation internationale du gouvernement angolais, RegS 9,125 %, 26 novembre 49	Titres liés à un État	1,03	Angola
Obligation internationale du gouvernement paraguayen, RegS 5,4 %, 30 mars 50	Titres liés à un État	0,93	Paraguay
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 19 mars 24	Produits dérivés	0,90	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 19 décembre 23	Produits dérivés	0,88	États-Unis
Obligation internationale du gouvernement argentin, FRB, 09 juillet 41	Titres liés à un État	0,83	Argentine
Petroleos Mexicanos, 7,69 %, 23 janvier 50	Titres liés à un État	0,78	Mexique
Obligation internationale du gouvernement dominicain, RegS 5,875 %, 30 janvier 60	Titres liés à un État	0,78	République dominicaine
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 28 mars 24	Produits dérivés	0,77	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 29 décembre 23	Produits dérivés	0,76	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 29 septembre 23	Produits dérivés	0,71	États-Unis
Obligation internationale du gouvernement nigérian, RegS 7,375 %, 28 septembre 33	Titres liés à un État	0,66	Nigeria

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

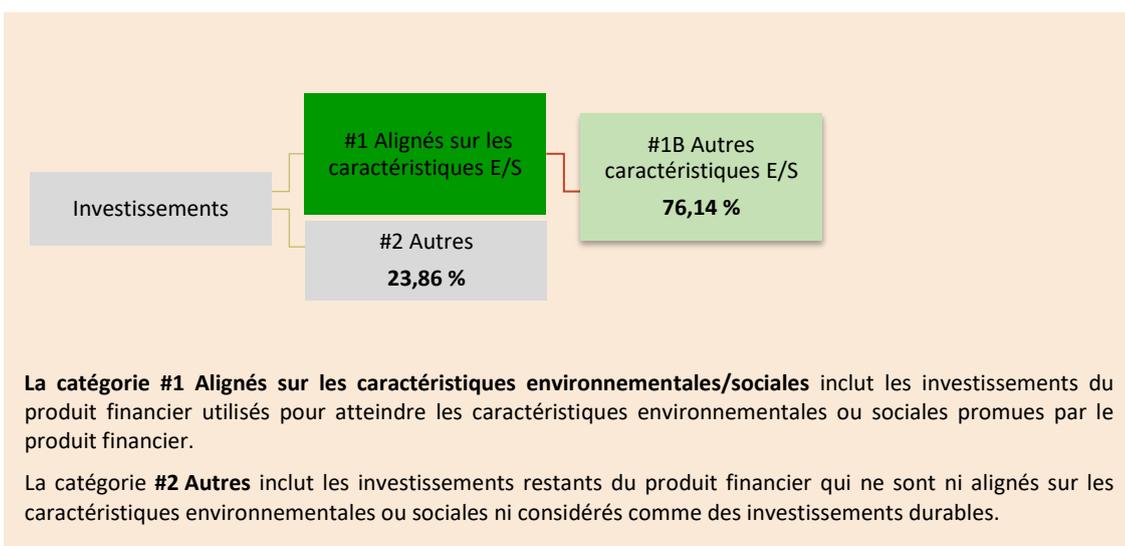


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Emerging Markets Debt Fund vise à ce qu'au moins 50 % des Actifs éligibles répondent aux Caractéristiques MFS à compter du 28 août 2023 et soient donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Emerging Markets Debt Fund (catégorie #1) à compter de la date d'effet. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les Actifs éligibles représentaient 90,59 % de l'actif total du portefeuille du MFS Emerging Markets Debt Fund (dont 63,78 % étaient des titres de créance souverains et 12,36 % étaient des titres de créance d'entreprises) ; les investissements restants (26,81 % du portefeuille) comprenaient des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 84,05 % des Actifs éligibles du portefeuille du MFS Emerging Markets Debt Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 76,14 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign ou la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 23,86 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS ni considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



L'allocation des actifs

décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Secteurs	Pondération moyenne en %
Gouvernement – titres souverains liés à un État	45,32
Gouvernement – agences gouvernementales	19,13
Sociétés privées – industrie	12,93
Produits dérivés – négociés en bourse	8,00
Liquidités – Liquidités	7,27
Sociétés privées – services publics	6,09
Trésor – bons du Trésor	5,71
Sociétés privées – établissements financiers	3,19
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,18
Gouvernement – organismes supranationaux liés à un gouvernement	0,09
Produits dérivés – de gré à gré	0,02
Autre	-0,19

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



● **Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS Emerging Markets Debt Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?**

Oui :

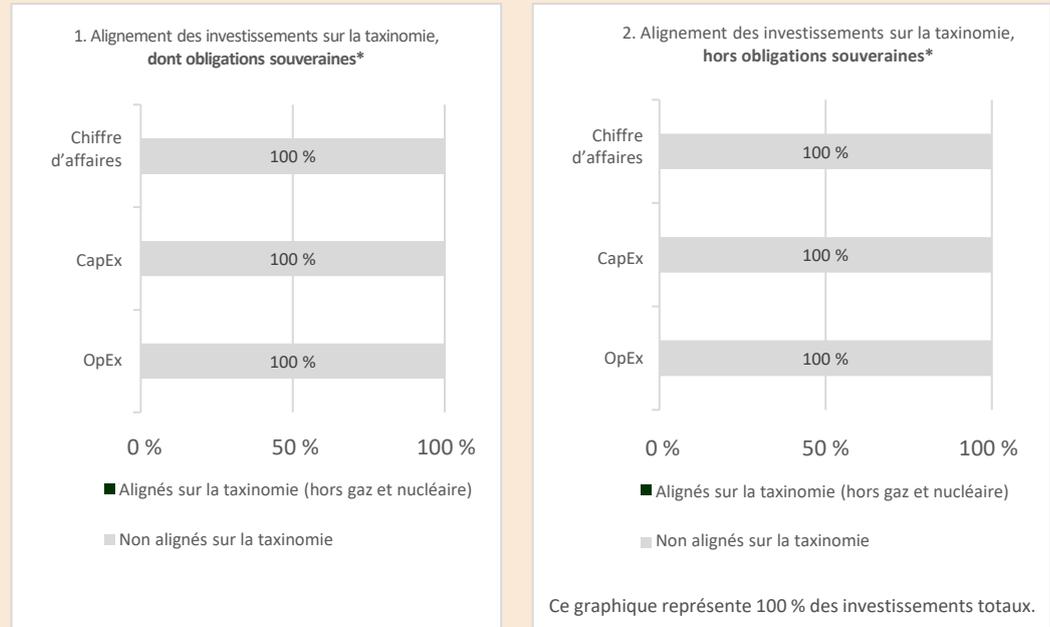
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Emerging Markets Debt Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Emerging Markets Debt Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

S/O.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Emerging Markets Debt Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.

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 de la taxinomie de l'UE.





Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les actifs liés aux créances d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés, ainsi que de produits dérivés de change, qui ne respectent pas les garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Emerging Markets Debt Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements - MFS Emerging Markets Debt Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 4 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Enel S.p.A., Engie SA, Sasol Ltd et Saudi Arabian Oil Co. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque physique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Emerging Markets Debt Local Currency Fund (« **MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund** »)

Identifiant d'entité juridique : UQHM30IE5XP13N5F8C87

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-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** : _____ %

No

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

À compter du 28 août 2023, le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund a promu la caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign et la caractéristique MFS Low Carbon Transition grâce auxquelles MFS a évalué les émetteurs de titres de créance d'État et liés aux États (« émetteurs de titres de créance souverains ») et les émetteurs de titres de créance d'entreprises (le cas échéant) au regard des indicateurs ou critères de la caractéristique applicable. En particulier, le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund détiendra au moins 50 % des titres de créance souverains et d'entreprises combinés du portefeuille (les « Actifs éligibles ») investis dans : des émetteurs de titres de créance souverains qui répondent à au moins un des cinq indicateurs de la caractéristique MFS Emerging Markets Debt ; et/ou des émetteurs de titres de créance d'entreprises qui répondent à au moins un des quatre critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Au 31 janvier 2024, 97,12 % des Actifs éligibles du portefeuille du MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund répondaient à au moins un des indicateurs ou critères climatiques, ce qui représentait 86,65 % de l'actif total (dont 85,00 % étaient des titres de créance souverains et 1,65 % étaient des titres de créance d'entreprises). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de

ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les informations périodiques ci-dessous couvrent la période allant du 28 août 2023 au 31 janvier 2024 et concernent la caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign ou la caractéristique MFS Low Carbon Transition (les « Caractéristiques MFS »).

Caractéristiques MFS	% des Actifs éligibles du portefeuille répondant aux Caractéristiques MFS	% de l'actif total du portefeuille répondant aux Caractéristiques MFS
31 janvier 2024	97,12	86,86

Les informations périodiques ci-dessous couvrent la période allant du 28 août 2023 au 31 janvier 2024 et concernent la caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign. Veuillez noter que les émetteurs privés détenus à 100 % par une entité souveraine sont considérés comme des titres de créance souverains liés à un État admissibles à l'examen au titre de cette caractéristique.

Indicateur national du Pilier éducation du Legatum Prosperity Index™ (le « Pilier éducation de Legatum ») – pourcentage (%) de titres de créance souverains du portefeuille émis par des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après). L'indice Legatum Prosperity Index™ est la propriété de Legatum Institute Limited.

Indicateur Éducation de Legatum	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	69,67	62,16

Indicateur national du Pilier santé du Legatum Prosperity Index™ (l'« Indicateur santé de Legatum ») – pourcentage (%) de titres de créance souverains du portefeuille émis par des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après). L'indice Legatum Prosperity Index™ est la propriété de Legatum Institute Limited.

Indicateur santé de Legatum	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	59,65	53,22

Score moyen en matière de corruption (Indicateur des principales incidences négatives 21), fondé sur l'indicateur de Contrôle de la corruption issu des Indicateurs de gouvernance mondiale (« WGI ») de la Banque mondiale – pourcentage (%) de titres de créance souverains du portefeuille émis par des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Indicateur de Contrôle de la corruption du WGI	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	33,26	29,67

Score moyen en matière de stabilité politique (Indicateur des principales incidences négatives 23) fondé sur l'indicateur de Stabilité politique et d'Absence de violence/terrorisme du WGI – pourcentage (%) de titres de créance souverains du portefeuille émis par des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Indicateur de Stabilité politique et d'Absence de violence/terrorisme du WGI	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	63,55	56,70

Score moyen en matière d'État de droit (Indicateur des principales incidences négatives 24) fondé sur l'indicateur de l'État de droit du WGI – pourcentage (%) de titres de créance souverains du portefeuille émis par des émetteurs de titres de créance souverains répondant à cet indicateur, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Indicateur de l'État de droit du WGI	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à cet indicateur	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	55,37	49,40

Conformité aux indicateurs – mesure du pourcentage (%) de titres de créance souverains du portefeuille qui respectaient au moins l'un des cinq indicateurs ci-dessus tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Indicateurs MFS Emerging Markets Sovereign	% de titres de créance souverains du portefeuille répondant à l'un des indicateurs	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des indicateurs
31 janvier 2024	95,28	85,01

Les informations périodiques ci-dessous couvrent la période allant du 28 août 2023 au 31 janvier 2024 et concernent la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Veuillez noter que les émetteurs privés qui ne sont pas entièrement détenus par une entité souveraine sont considérés comme des actifs admissibles à l'examen au titre de cette caractéristique.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	1,84	1,65

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0,34	0,30

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d’entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d’adaptation et/ou d’atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d’entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l’actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d’entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l’un des Critères climatiques (1, 2, 3 et/ou 4) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d’entreprises du portefeuille répondant à l’un des critères	% de l’actif total du portefeuille répondant à l’un des critères
31 janvier 2024	1,84	1,65

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n’ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d’investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s’accompagne de critères propres à l’UE.

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’Union européenne 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’Union européenne en matière d’activités économiques durables sur le plan environnemental.



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.

Le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund.

La caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign intègre les indicateurs suivants des principales incidences négatives en matière de gouvernance applicables aux émetteurs souverains :

- Score moyen en matière de corruption ;
- Score moyen en matière de stabilité politique ;
- Score moyen en matière d'état de droit.

Le Critère climatique 1 de la caractéristique MFS Low Carbon Transition est mesuré à l'aide des indicateurs des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants :

- émissions de GES (Niveaux 1 et 2 et, le cas échéant, 3) ;
- Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements

Afin de compléter la promotion de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, MFS met à la disposition des professionnels de l'investissement de MFS les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants :

- empreinte carbone ;
- exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles ;
- part de la consommation d'énergie non renouvelable ;
- intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique ;
- (collectivement, les « Indicateurs d'émissions supplémentaires »).

MFS communique également les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants :

- violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales ;
- mixité au sein des organes de gouvernance

Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles. Des informations sur la façon dont les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable (ESG) ont été examinées seront communiquées dans le rapport annuel.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Obligations du Trésor brésilien, Série F 10 %, 1er janvier 27	Bons du Trésor	5,46	Brésil
Obligations du Trésor colombien, 5,75 % 03 novembre 27	Bons du Trésor	3,58	Colombie
Obligations du Trésor thaïlandais, 3,775 %, 25 juin 32	Bons du Trésor	3,55	Thaïlande
Obligations du Trésor péruvien, 6,95 %, 12 août 31	Bons du Trésor	3,53	Pérou
Bons du Trésor mexicain, 5 %, 06 mars 25	Bons du Trésor	3,38	Mexique
Bons du Trésor roumain, 4,75 %, 24 février 25	Bons du Trésor	3,26	Roumanie
Obligations du Trésor brésilien, 0 %, 1er janvier 26	Bons du Trésor	3,23	Brésil
Obligations du Trésor tchèque, 2 %, 13 octobre 33	Bons du Trésor	2,96	Tchéquie
Obligations du Trésor brésilien, Série F 10 %, 1er janvier 25	Bons du Trésor	2,90	Brésil
Obligations du Trésor indonésien, 6,375 %, 15 août 28	Bons du Trésor	2,74	Indonésie
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 29 septembre 23	Produits dérivés	2,74	États-Unis
Obligations du Trésor sud-africain, 9 %, 31 janvier 40	Bons du Trésor	2,63	République d'Afrique du Sud
TIIIE en MXN à 2 ans, receveur, 9,830, 20 décembre 25	Produits dérivés	2,59	Mexique
Obligations du Trésor chinois, 2,88 %, 25 février 33	Bons du Trésor	2,57	Chine
IRS en CZK à 2 ans, receveur, 4,640, 20 décembre 25	Produits dérivés	2,39	Tchéquie

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 28 août 2023 au 31 janvier 2024.

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

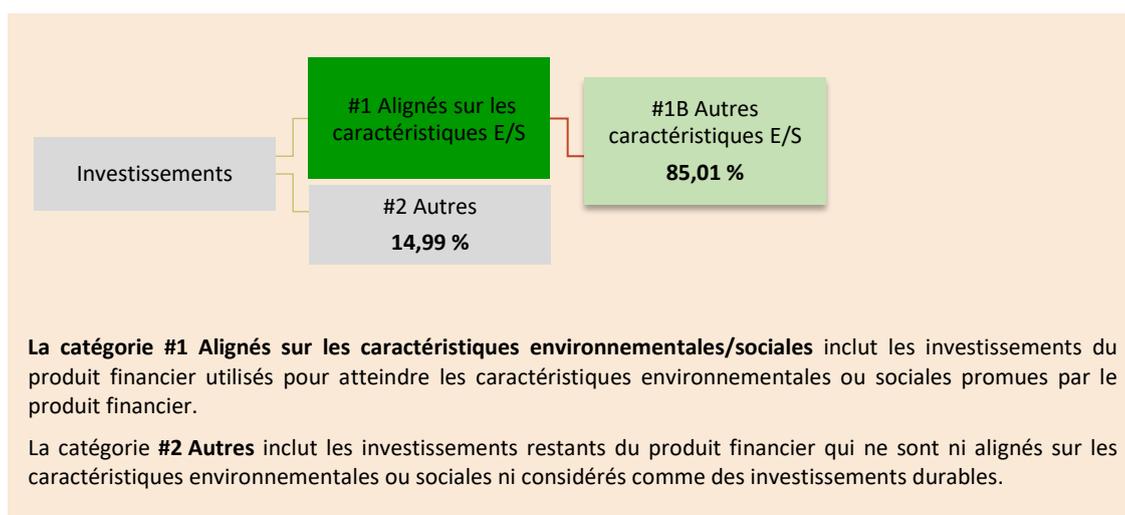


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund vise à ce qu'au moins 50 % des Actifs éligibles répondent aux Caractéristiques MFS à compter du 28 août 2023 et soient donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund (catégorie #1) à compter de la date d'effet. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les Actifs éligibles représentaient 89,22 % de l'actif total du portefeuille du MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund (dont 85,01 % étaient des titres de créance souverains et 3,80 % étaient des titres de créance d'entreprises); les investissements restants (19,53 % du portefeuille) comprenaient des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 97,12 % des Actifs éligibles du portefeuille du MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 85,01 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Emerging Markets Sovereign ou la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 14,99 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS ni considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Secteurs	Pondération moyenne en %
Trésor – bons du Trésor	84,31
Produits dérivés – négociés en bourse	14,07
Liquidités – Liquidités	6,64
Gouvernement – titres souverains liés à un État	2,89
Gouvernement – agences gouvernementales	2,62
Sociétés privées – industrie	2,07
Sociétés privées – établissements financiers	1,37
Produits dérivés – de gré à gré	0,94
Sociétés privées – services publics	0,39
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,36
Non classifié	-0,24

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



● **Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?**

Oui :

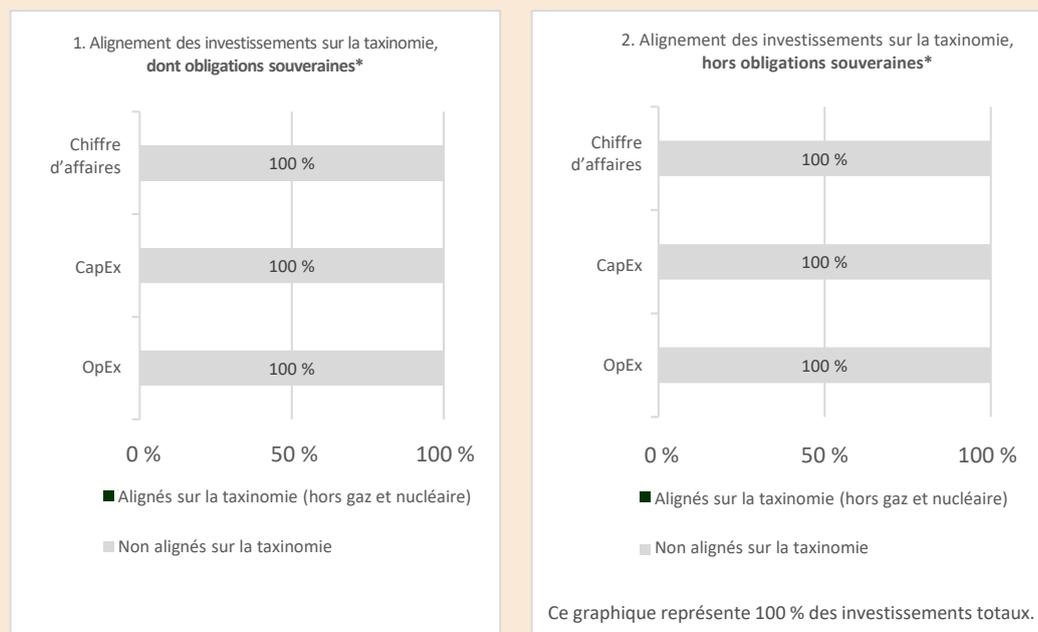
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

S/O.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.

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 de la taxinomie de l'UE.





Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les actifs liés aux créances d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés, ainsi que de produits dérivés de change, qui ne respectent pas les garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Emerging Markets Debt Local Currency Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.



Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Concentrated Fund (« MFS Global Concentrated Fund »)
Identifiant d'entité juridique : BMRYOZKI2EE3QEBKPG73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Concentrated Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Concentrated Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 94,18 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Concentrated Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 93,23 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,99 % de l'actif du MFS Global Concentrated Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	80,98	80,17
31 janvier 2023	69,12	68,02
30 novembre 2021	73,91	70,03

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	86,90	86,03
31 janvier 2023	64,39	63,37
30 novembre 2021	67,20	66,38

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	94,18	93,23
31 janvier 2023	82,50	81,19
30 novembre 2021	96,46	95,31



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Concentrated Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Concentrated Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**



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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Visa Inc	Finance	5,84	États-Unis
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	5,04	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	5,02	France
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	4,73	France
Medtronic PLC	Soins de santé	4,70	États-Unis
Accenture PLC	Technologies de l'information	4,69	États-Unis
Cie Financière Richemont SA	Biens de consommation discrétionnaire	4,25	Suisse
Canadian National Railway Co	Industrie	4,11	Canada
Roche Holding AG	Soins de santé	4,08	Suisse
Goldman Sachs Group Inc	Finance	3,99	États-Unis
Linde PLC	Matériaux	3,97	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 11 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.



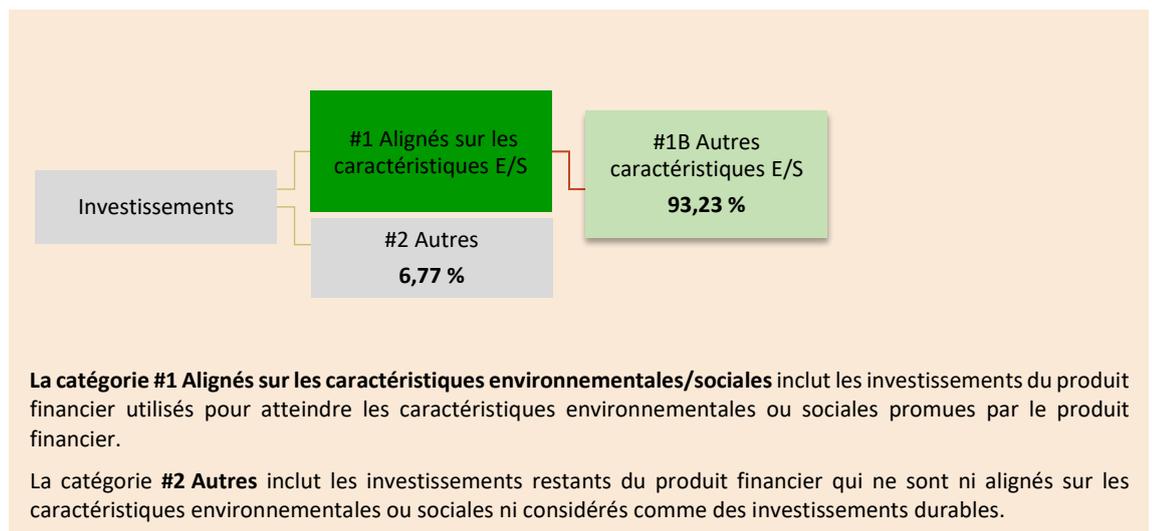
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Concentrated Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Concentrated Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 98,99 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Concentrated Fund ; les investissements restants (1,01 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 94,18 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Concentrated Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 93,23 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 6,77 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Soins de santé	20,81
Industrie	17,87
Finance	13,85
Biens de consommation courante	13,42
Technologies de l'information	9,82
Biens de consommation discrétionnaire	8,98
Services de communication	8,18
Matériaux	5,94
Liquidités et instruments assimilés	0,77
Warrants sur actions	0,17
Autre	-0,05

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Concentrated Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui :

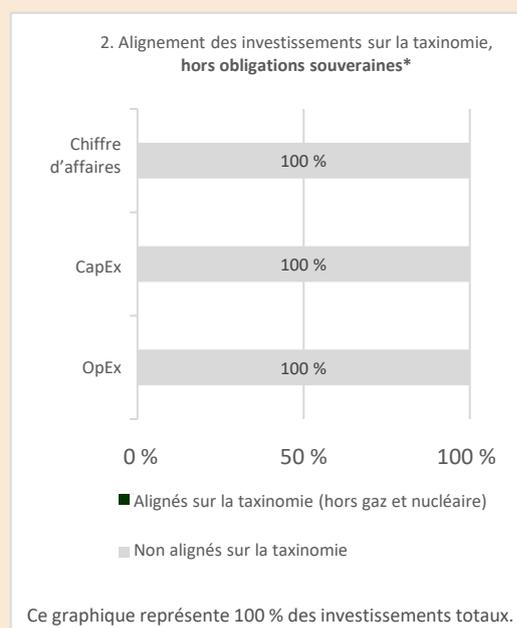
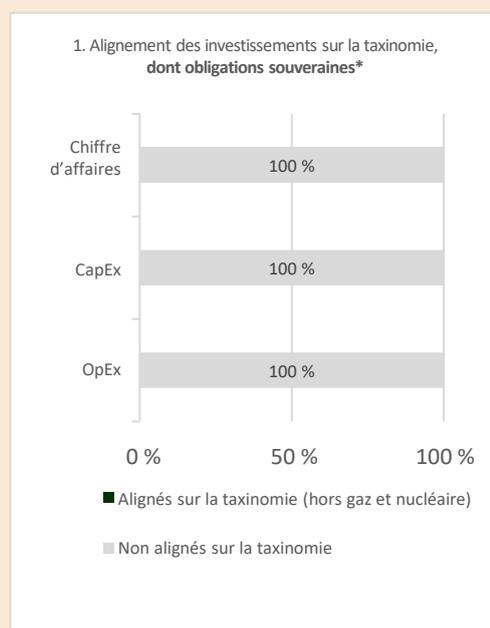
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire



Non. Le MFS Global Concentrated Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Global Concentrated Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

 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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Concentrated Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Concentrated Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Concentrated Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 3 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Diageo PLC, Schneider Electric SE et Thermo Fisher Scientific Inc. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique et les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Canadian National Railway Company et Schneider Electric SE. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : United Parcel Service, Inc. et Honeywell International Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : The Goldman Sachs Group, Inc. et Comcast Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Credit Fund (« MFS Global Credit Fund »)
Identifiant d'entité juridique : N3QJ8XUW2UNVZ3ZBYQ23

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Credit Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Credit Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 74,70 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Credit Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 65,41 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 87,57 % de l'actif du MFS Global Credit Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	65,31	57,19
31 janvier 2023	58,44	47,06
30 novembre 2021	58,93	48,71

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	33,56	29,39
31 janvier 2023	33,49	26,97
30 novembre 2021	34,71	28,69

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	5,44	4,76
31 janvier 2023	5,45	4,39
30 novembre 2021	4,62	3,82

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2, 3 et/ou 4) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	74,70	65,41
31 janvier 2023	71,82	57,83
30 novembre 2022	75,40	62,32

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

S/O.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Credit Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions

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.

d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Credit Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Itraxx Europe Série 39, receveur, 75,00, 19 juillet 23	Produit dérivé	2,84	Allemagne
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 29 décembre 23	Gouvernement	2,49	Mexique
Itraxx Europe Crossover Série 40, receveur, 350,00, 15 mai 24	Produit dérivé	2,28	Irlande
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 28 mars 24	Gouvernement	2,21	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 29 septembre 23	Gouvernement	1,74	États-Unis
Itraxx Europe Crossover Série 40, receveur, 300,00, 15 mai 24	Produit dérivé	1,39	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Contrat à terme standardisé à 30 ans sur obligation du Trésor américain, 19 mars 24	Gouvernement	1,31	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 30 ans sur obligation du Trésor américain, 20 septembre 23	Gouvernement	1,23	Chine
Contrat à terme standardisé à 30 ans sur obligation du Trésor américain, 19 décembre 23	Gouvernement	1,23	Allemagne
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 juin 23	Gouvernement	1,16	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 30 ans sur obligation du Trésor américain, 21 juin 23	Gouvernement	0,95	États-Unis
Westinghouse Air Brake Technologies Corp, FRB, 15 septembre 28	Entreprise	0,79	Organisme supranational
Ubisoft Entertainment SA, RegS 0,878 %, 24 novembre 27	Entreprise	0,76	États-Unis
UBS GROUP AG, 144A FRB, 11 février 33	Entreprise	0,65	États-Unis
Bank of America Corp, FRB, 22 avril 32	Entreprise	0,64	Chine

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Credit Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Credit Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 87,57 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Credit Fund ; les investissements restants du portefeuille comprenaient des titres de créance non émis par des sociétés, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 74,70 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Credit Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 65,41 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 34,59 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Sociétés privées – industrie	42,29
Sociétés privées – établissements financiers	36,34
Sociétés privées – services publics	8,97
Gouvernement – agences gouvernementales	5,36
Produits dérivés – négociés en bourse	3,54
Liquidités – Liquidités	2,84
Gouvernement – organismes supranationaux liés à un gouvernement	1,83
Gouvernement – titres souverains liés à un État	1,45
Trésor – bons du Trésor	0,63
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,62
Titrisation – titres adossés à des actifs	0,37
Obligations municipales – éducation	0,16
Obligations municipales – santé	0,16
Produits dérivés – de gré à gré	0,04

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Credit Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



● **Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?**

Oui :

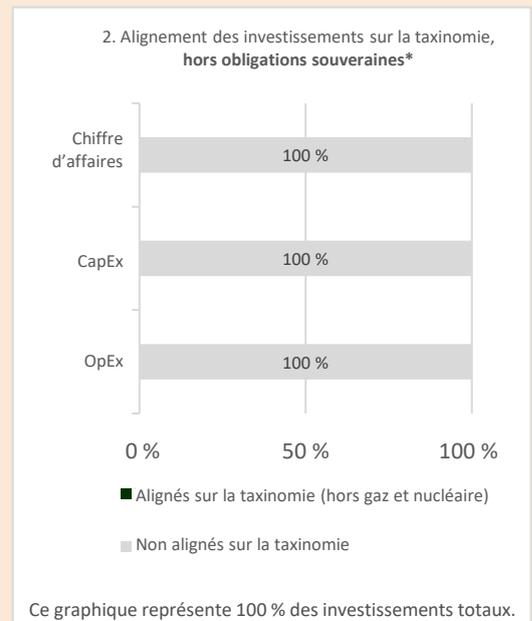
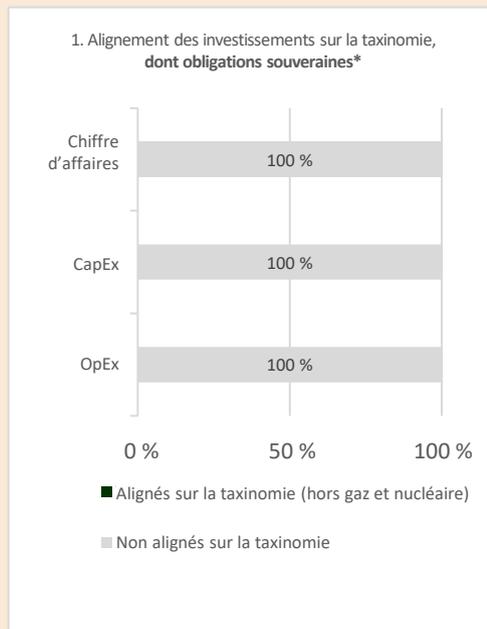
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire



Non. Le MFS Global Credit Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Global Credit Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Credit Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Credit Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

 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 de la taxinomie de l'UE.



Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements - MFS Global Credit Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 18 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : APA Group, Bank of America Corp, Duke Energy Corp, E.ON SE, Enel SpA, Engie SA, Glencore PLC, National Grid PLC, RAC Bond Co PLC, Southern Co, Thermo Fisher Scientific Inc, United Parcel Service Co, Volkswagen AG, Vulcan Materials Co et Westinghouse Air Brake Technologies Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque physique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Equity Fund (« **MFS Global Equity Fund** »)
Identifiant d'entité juridique : YAHWU2BYOY7SCHWC8194

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

À compter du 31 décembre 2021, le MFS Global Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 92,57 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 92,51 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,93 % de l'actif du MFS Global Equity Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	80,61	80,55
31 janvier 2023	63,97	63,42
30 novembre 2021	69,34	68,94

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	79,64	79,59
31 janvier 2023	65,39	64,83
30 novembre 2021	60,40	60,04

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	92,57	92,51
31 janvier 2023	80,79	80,10
30 novembre 2021	86,59	86,09



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Equity Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Equity Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Visa Inc	Finance	3,02	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	2,96	France
Linde PLC	Matériaux	2,76	États-Unis
Thermo Fisher Scientific Inc	Soins de santé	2,56	États-Unis
Medtronic PLC	Soins de santé	2,47	États-Unis
Comcast Corp	Services de communication	2,45	États-Unis
Accenture PLC	Technologies de l'information	2,42	États-Unis
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	2,36	France
Roche Holding AG	Soins de santé	2,29	Suisse
Nestlé SA	Biens de consommation courante	2,15	Suisse
Honeywell International Inc	Industrie	2,09	États-Unis
Diageo PLC	Biens de consommation courante	2,01	Royaume-Uni
Oracle Corp	Technologies de l'information	1,92	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	1,90	États-Unis
Willis Towers Watson PLC	Finance	1,89	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard

(GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



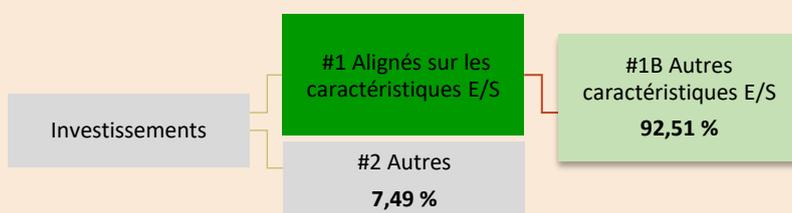
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 99,93 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Equity Fund ; les investissements restants (0,07 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 92,57 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 92,51 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 7,49 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie #1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales 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.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Industrie	19,31
Soins de santé	18,32
Finance	16,26
Biens de consommation courante	11,85
Technologies de l'information	10,34
Biens de consommation discrétionnaire	8,05
Services de communication	7,80
Matériaux	7,01
Liquidités et instruments assimilés	0,62
Warrants sur actions	0,05
Autre	0,04

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

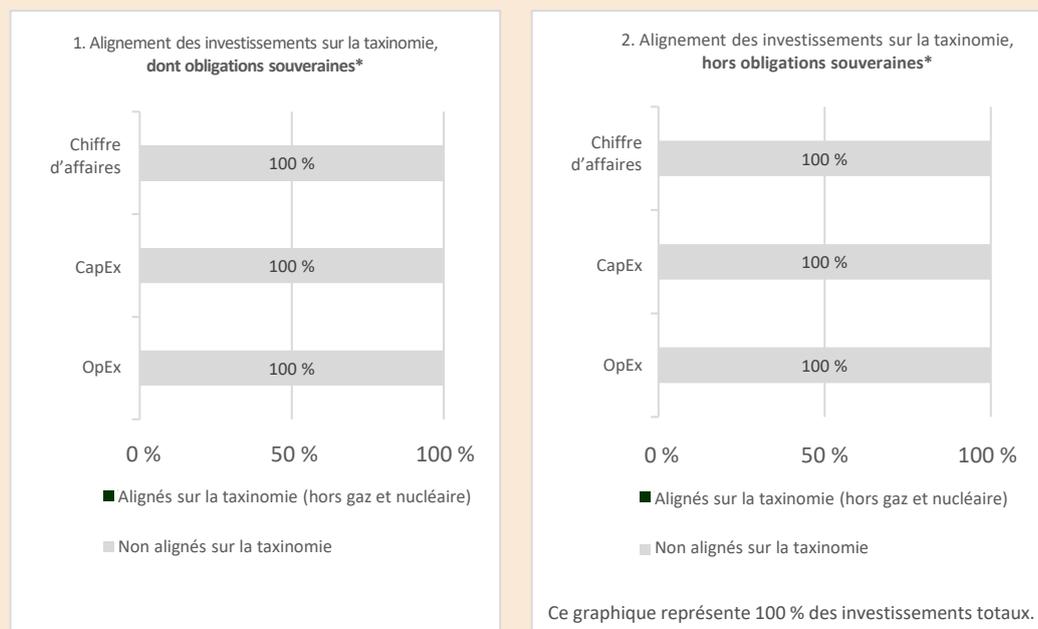
Zéro. Le MFS Global Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui :
 Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Global Equity Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Global Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS Global Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

 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 de la taxinomie de l'UE.





Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Equity Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 10 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Edison International, Erste Group Bank AG, Glencore PLC, Iberdrola SA, Omnicom Group Inc, Samsung Electronics, Suncor Energy Inc et Valero Energy Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : UBS Group AG, Aena S.M.E. SA, Canadian National Railway Company, Schneider Electric SE et Canadian Pacific Kansas City Limited. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : United Parcel Service, Inc., Alphabet Inc. et Honeywell International Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : The Goldman Sachs Group, Inc. et Comcast Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-entreprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Equity Income Fund (« **MFS Global Equity Income Fund** »)

Identifiant d'entité juridique : 22210022D2KOH05J2W88

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 30 novembre 2022, le MFS Global Equity Income Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Equity Income Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 87,44 % des titres de participation du portefeuille MFS Global Equity Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 85,79 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,11 % de l'actif du MFS Global Equity Income Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	75,69	74,26
31 janvier 2023	59,03	58,29
31 octobre 2022	64,82	63,83

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	57,44	56,36
31 janvier 2023	58,78	58,04
31 octobre 2022	58,20	57,31

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
31 octobre 2022	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	87,44	85,79
31 janvier 2023	75,20	74,26
31 octobre 2022	79,82	78,61



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veuillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Equity Income Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Equity Income Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Rio Tinto PLC	Matériaux	3,09	Royaume-Uni
Roche Holding AG	Soins de santé	2,91	Suisse
Texas Instruments Inc	Technologies de l'information	2,78	États-Unis
DBS Group Holdings Ltd	Finance	2,75	Singapour
General Mills Inc	Biens de consommation courante	2,74	États-Unis
Manulife Financial Corp	Finance	2,73	Canada
Kimberly-Clark Corp	Biens de consommation courante	2,67	États-Unis
Merck & Co Inc	Soins de santé	2,57	États-Unis
General Dynamics Corp	Industrie	2,53	États-Unis
KDDI Corp	Services de communication	2,42	Japon
Johnson & Johnson	Soins de santé	2,28	États-Unis
Omnicom Group Inc	Services de communication	2,07	États-Unis
Phillips 66	Énergie	1,87	États-Unis
Comcast Corp	Services de communication	1,87	États-Unis
Colgate-Palmolive Co	Biens de consommation courante	1,77	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence

d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



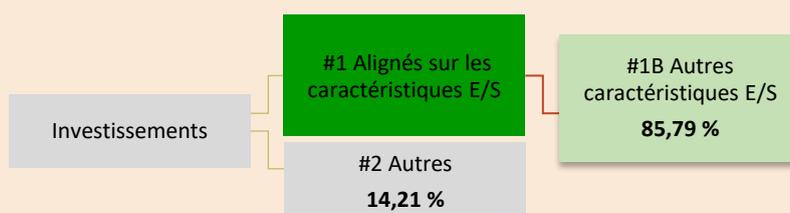
L'allocation des actifs
décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Equity Income Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS MFS Global Equity Income Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 98,11 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Equity Income Fund ; les investissements restants (1,89 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 87,44 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Equity Income Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 85,79 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 14,21 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Soins de santé	17,12
Biens de consommation courante	15,93
Finance	15,76
Énergie	8,93
Technologies de l'information	8,63
Matériaux	7,83
Services de communication	7,42
Industrie	6,42
Biens de consommation discrétionnaire	4,66
Services publics	3,80
Immobilier	1,74
Liquidités et instruments assimilés	1,17
Obligations convertibles	0,18
Autre	0,06

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



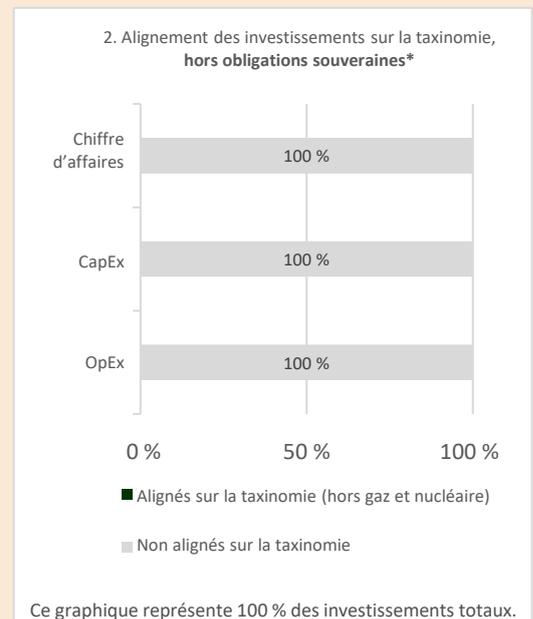
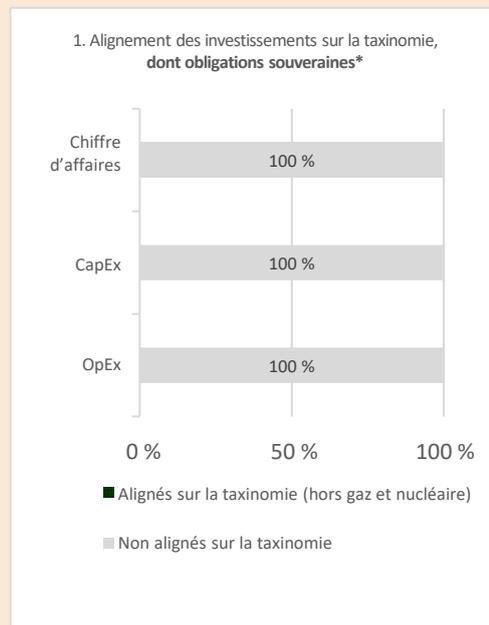
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Equity Income Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non. Le MFS Global Equity Income Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Global Equity Income Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
31 octobre 2022	0 %	0 %	0 %

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Equity Income Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Equity Income Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

 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 de la taxinomie de l'UE.



Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Vote par procuration - MFS Global Equity Income Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 10 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Edison International, Erste Group Bank AG, Glencore PLC, Iberdrola SA, Omnicom Group Inc, Samsung Electronics, Suncor Energy Inc et Valero Energy Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Total Energies SE. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Glencore Plc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Coterra Energy Inc., Texas Roadhouse, Inc. et Exxon Mobil Corporation. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Suncor Energy Inc, Valero Energy Corporation, The Hartford Financial Services

Group, Inc, Glencore Plc, Total Energies SE, Exxon Mobil Corporation, Comcast Corporation et Microsoft Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales 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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Listed Infrastructure Fund (« MFS Global Listed Infrastructure Fund »)

Identifiant d'entité juridique : 5493000HOQZBG78W0H47

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



Les **indicateurs de durabilité** mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

À compter du 28 août 2023, le MFS Global Listed Infrastructure Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Listed Infrastructure Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 80,91 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Listed Infrastructure Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 79,43 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,16 % de l'actif du MFS Global Listed Infrastructure Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 28 août 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	71,08	69,78

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	59,44	58,35

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	80,91	79,43

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Listed Infrastructure Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Listed Infrastructure Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS ont pris en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

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 problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 28 août 2023 au 31 janvier 2024.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
SBA Communications Corp REIT	Immobilier	5,18	États-Unis
Sempra	Services publics	5,12	États-Unis
Aena SME SA	Industrie	4,57	Espagne
CSX Corp	Industrie	4,29	États-Unis
Cellnex Telecom SA	Services de communication	3,99	Espagne
TC Energy Corp	Énergie	3,74	Canada
Dominion Energy Inc	Services publics	3,53	États-Unis
Xcel Energy Inc	Services publics	3,48	États-Unis
Union Pacific Corp	Industrie	3,47	États-Unis
National Grid PLC	Services publics	3,45	Royaume-Uni
PPL Corp	Services publics	3,21	États-Unis
RWE AG	Services publics	3,00	Allemagne
PG&E Corp	Services publics	2,93	États-Unis
Canadian National Railway Co	Industrie	2,86	Canada
Alliant Energy Corp	Services publics	2,77	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



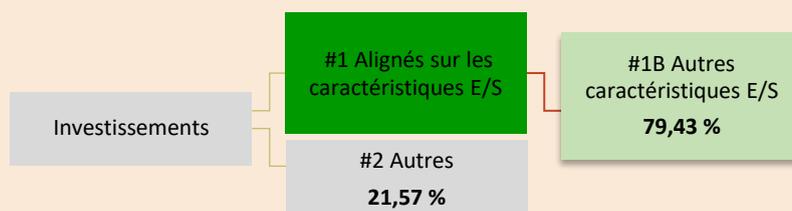
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Le MFS Global Listed Infrastructure Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Listed Infrastructure Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 98,16 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Listed Infrastructure Fund ; les investissements restants (1,84 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 80,91 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Listed Infrastructure Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 79,43 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 21,57 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Services publics	55,59
Industrie	25,12
Services de communication	5,82
Immobilier	5,18
Énergie	3,74
Matériaux	2,67
Liquidités et instruments assimilés	1,80
Autre	0,08

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

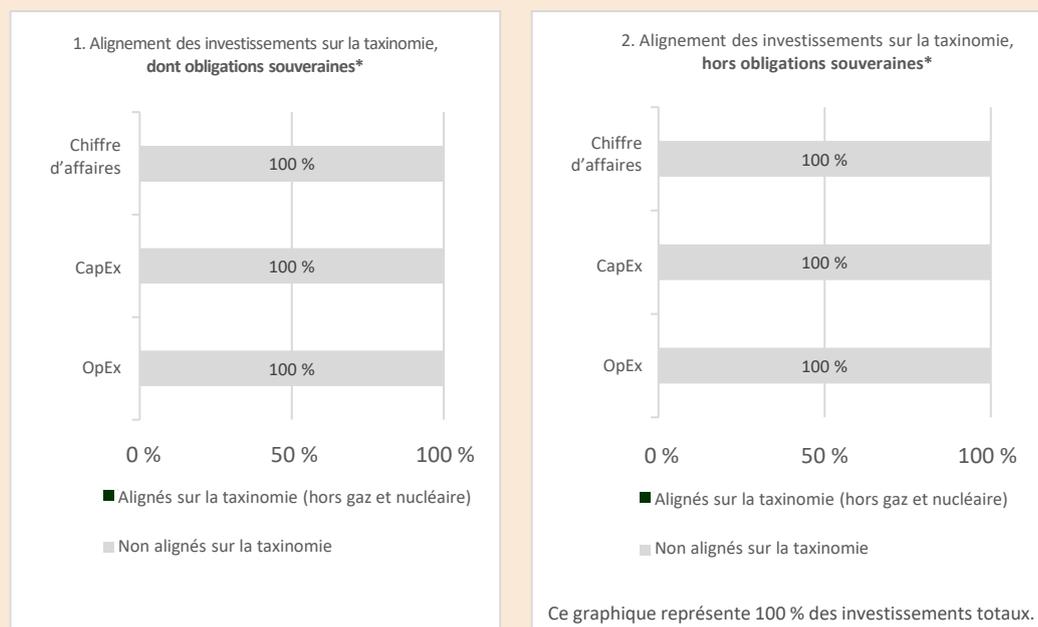
Zéro. Le MFS Global Listed Infrastructure Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Global Listed Infrastructure Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Global Listed Infrastructure Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

S/O.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Listed Infrastructure Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Listed Infrastructure Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».



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 de la taxinomie de l'UE.

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements - MFS Global Listed Infrastructure Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 5 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : APA Group, Edison International, Enel SpA, Iberdrola SA et National Grid PLC. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales 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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Intrinsic Value Fund (« **MFS Global Intrinsic Value Fund** »)

Identifiant d'entité juridique : 549300HBJQZCF0H6EK74

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Intrinsic Value Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Intrinsic Value Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 84,22 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Intrinsic Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 82,53 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 97,98 % de l'actif du MFS Global Intrinsic Value Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	72,23	70,77
31 janvier 2023	56,77	55,56
30 novembre 2021	58,16	57,63

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	61,98	60,73
31 janvier 2023	52,65	51,52
30 novembre 2021	44,4	44,0

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	84,22	82,53
31 janvier 2023	71,95	70,41
30 novembre 2021	69,90	69,26



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veuillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Intrinsic Value Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Intrinsic Value Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	2,56	États-Unis
Cadence Design Systems Inc	Technologies de l'information	2,43	États-Unis
Synopsys Inc	Technologies de l'information	2,18	États-Unis
TotalEnergies SE	Énergie	1,97	France
Colgate-Palmolive Co	Biens de consommation courante	1,93	États-Unis
Aon PLC	Finance	1,77	États-Unis
Costco Wholesale Corp	Biens de consommation courante	1,74	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	1,73	France
Analog Devices Inc	Technologies de l'information	1,63	États-Unis
Watts Water Technologies Inc	Industrie	1,59	États-Unis
Franco-Nevada Corp	Matériaux	1,57	Canada
Charles Schwab Corp	Finance	1,54	États-Unis
Woodside Energy Group Ltd	Énergie	1,51	Australie
CME Group Inc	Finance	1,48	États-Unis
Vulcan Materials Co	Matériaux	1,44	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



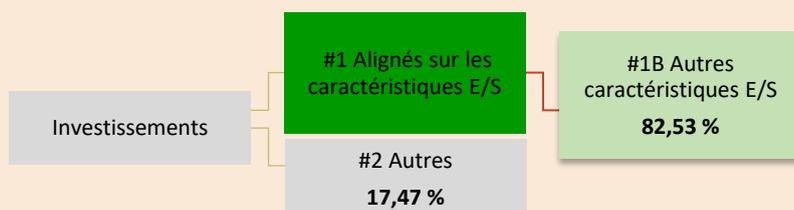
L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Intrinsic Value Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Intrinsic Value Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 97,98 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Intrinsic Value Fund ; les investissements restants (2,02 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 84,22 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Intrinsic Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 82,53 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 17,47 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologies de l'information	22,68
Industrie	21,15
Finance	15,02
Biens de consommation courante	11,89
Matériaux	10,61
Soins de santé	6,23
Énergie	4,57
Biens de consommation discrétionnaire	3,13
Liquidités et instruments assimilés	1,87
Services de communication	1,30
Immobilier	0,91
Autre	0,06

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

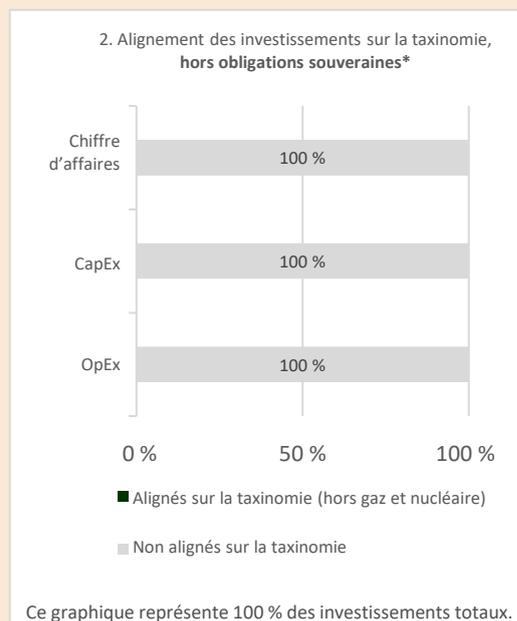
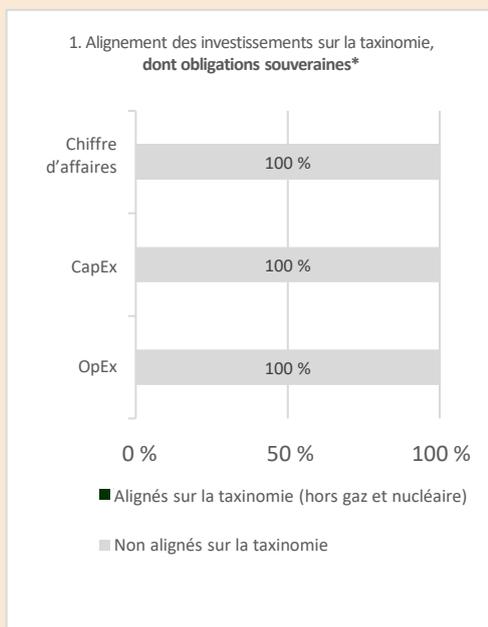
Zéro. Le MFS Global Intrinsic Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non. Le MFS Global Intrinsic Value Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

- Zéro. Le MFS Global Intrinsic Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.
- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Intrinsic Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Intrinsic Value Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

 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 de la taxinomie de l'UE.



Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Intrinsic Value Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 10 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Diageo PLC, Glencore PLC, Samsung Electronics Co Ltd, Schneider Electric SE, Sika AG, Vulcan Materials Co et Woodside Energy Group Ltd. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition et les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi). Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Schneider Electric SE et

TotalEnergies SE. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Glencore Plc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Martin Marietta Materials, Inc., Amazon.com, Inc. et Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Amazon.com, Inc., Glencore Plc, TotalEnergies SE et Microsoft Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Opportunistic Bond Fund (« **MFS Global Opportunistic Bond Fund** »)

Identifiant d'entité juridique : 222100ONK1WLJJOXR98

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Opportunistic Bond Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Opportunistic Bond Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 70,90 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Opportunistic Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 22,15 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 31,24 % de l'actif du MFS Global Opportunistic Bond Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	59,96	18,73
31 janvier 2023	49,55	17,22
30 novembre 2021	52,05	20,89

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	33,56	10,48
31 janvier 2023	30,11	10,46
30 novembre 2021	23,18	9,30

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	6,47	2,02
31 janvier 2023	8,33	2,89
30 novembre 2021	5,89	2,36

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	70,90	22,15
31 janvier 2023	66,44	23,08
30 novembre 2022	65,04	26,10

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

S/O.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Opportunistic Bond Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des

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.

émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Opportunistic Bond Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « Indicateurs d'émissions supplémentaires »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
IRS en USD à 2 ans, receveur, 3,412, 18 juin 27	Gouvernement	4,64	États-Unis
Obligations du Trésor coréen, 1.875 %, 10 juin 29	Gouvernement	3,23	Corée du Sud
Obligations du Trésor coréen, 1.375 %, 10 juin 30	Gouvernement	2,44	Corée du Sud
Bons du Trésor mexicain, 7,5 %, 03 juin 27	Gouvernement	2,42	Mexique
Itraxx Europe Crossover Série 40, receveur, 350,00, 15 mai 24	Produit dérivé	2,02	Allemagne
Obligations du Trésor grec, 4,25 %, 15 juin 33	Gouvernement	1,77	Grèce
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl, 07 décembre 23	Gouvernement	1,68	Allemagne
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl, 07 mars 24	Gouvernement	1,60	Allemagne

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Obligations du Trésor espagnol, 3,15 %, 30 avril 33	Gouvernement	1,55	Espagne
Itraxx Europe Série 39, receveur, 75,00, 19 juillet 23	Produit dérivé	1,46	Allemagne
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 28 mars 24	Gouvernement	1,45	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 5 ans sur obligation du Trésor américain, 29 décembre 23	Gouvernement	1,45	États-Unis
Itraxx Europe Crossover Série 40, receveur, 300,00, 15 mai 24	Produit dérivé	1,30	Allemagne
Obligations du Trésor grec, 1,75 %, 18 juin 32	Gouvernement	1,26	Grèce
Obligations du Trésor chinois, 2,88 %, 25 février 33	Gouvernement	1,25	Chine

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



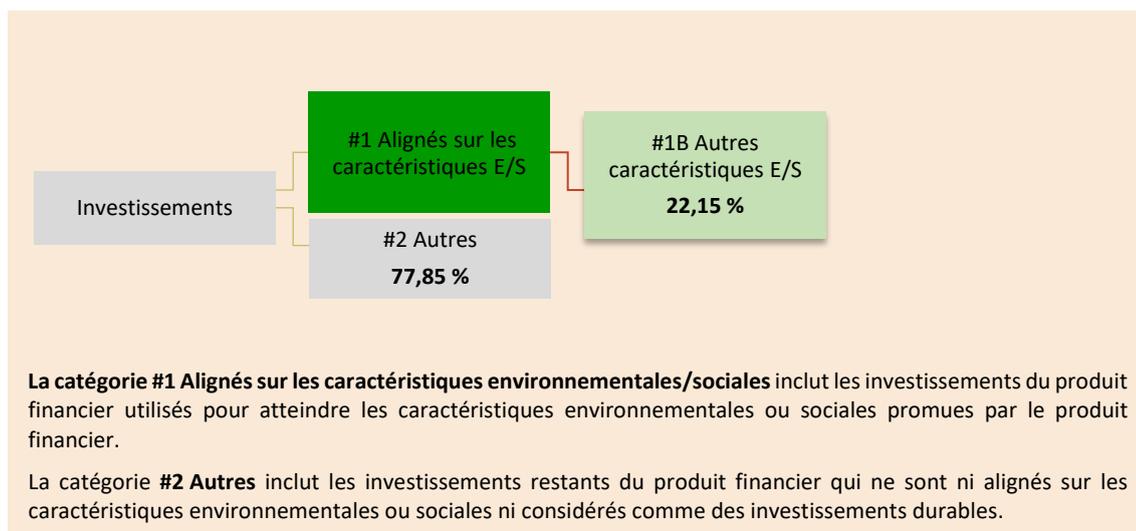
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Le MFS Global Opportunistic Bond Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Opportunistic Bond Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 31,24 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Opportunistic Bond Fund ; les investissements restants (69,76 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des sociétés, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 70,90 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Opportunistic Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 22,15 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 77,85 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Secteurs	Pondération moyenne en %
Trésor – bons du Trésor	42,54
Sociétés privées – industrie	18,47
Sociétés privées – établissements financiers	10,18
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires avec flux identiques	7,32
Produits dérivés – négociés en bourse	6,87
Sociétés privées – services publics	3,78
Titrisation – obligations de prêts garantis	3,71
Liquidités – Liquidités	3,69
Gouvernement – agences gouvernementales	3,54
Gouvernement – titres souverains liés à un État	2,58
Gouvernement – organismes supranationaux liés à un gouvernement	0,97
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	0,77
Titrisation – titres adossés à des actifs	0,60
Obligations municipales – éducation	0,52
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,50
Produits dérivés – de gré à gré	0,50
Obligations municipales – logement	0,31
Obligations municipales – santé	0,05

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Opportunistic Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui :

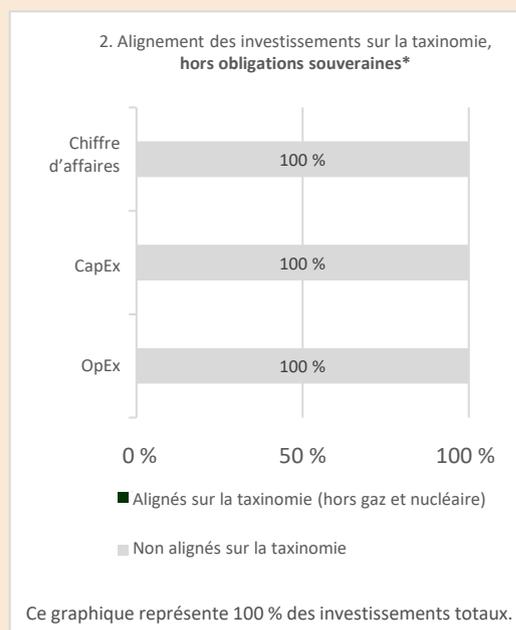
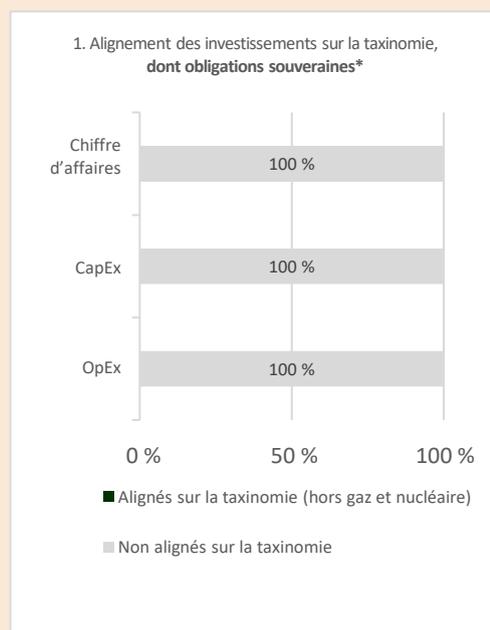
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire



Non. Le MFS Global Opportunistic Bond Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Global Opportunistic Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



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 de la taxinomie de l'UE. 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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Opportunistic Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Opportunistic Bond Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements - MFS Global Opportunistic Bond Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 23 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : APA Group, Bank of America Corp, Becton Dickinson & Co, Cable One Inc, Duke Energy Corp, E.ON SE, Enel SpA, Engie SA, Glencore PLC, National Grid PLC, Parkland Corp, Plains All American Pipeline LP, RAC Bond Co PLC, Sasol Ltd, Southern Co, Thermo Fisher Scientific Inc, United Parcel Service Inc, Volkswagen AG, Vulcan Materials Co et Westinghouse Air Brake Technologies Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque physique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales 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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Research Focused Fund (« **MFS Global Research Focused Fund** »)

Identifiant d'entité juridique : OXNVI8L269TT6JC97X03

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-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** : _____ %

No

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS Global Research Focused Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Research Focused Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 95,34 % des titres de participation du portefeuille MFS Global Research Focused Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 94,22 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,82 % de l'actif du MFS Global Research Focused Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	72,00	71,16
31 janvier 2023	69,98	69,60
30 novembre 2021	52,16	51,67

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	81,30	80,35
31 janvier 2023	57,58	57,27
30 novembre 2021	45,50	45,07

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	95,34	94,22
31 janvier 2023	83,30	82,85
30 novembre 2021	73,45	72,76



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veuillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Research Focused Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Research Focused Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**



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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	7,30	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	4,14	États-Unis
Amazon.com Inc	Biens de consommation discrétionnaire	3,21	États-Unis
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	3,09	France
Linde PLC	Matériaux	3,09	États-Unis
Mondelez International Inc	Biens de consommation courante	3,00	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	2,97	Suisse
Honeywell International Inc	Industrie	2,95	États-Unis
Visa Inc	Finance	2,66	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	2,66	France
Hitachi Ltd	Industrie	2,42	Japon
Aon PLC	Finance	2,41	États-Unis
NXP Semiconductors NV	Technologies de l'information	2,36	Pays-Bas
Medtronic PLC	Soins de santé	2,27	États-Unis
Becton Dickinson & Co	Soins de santé	2,24	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



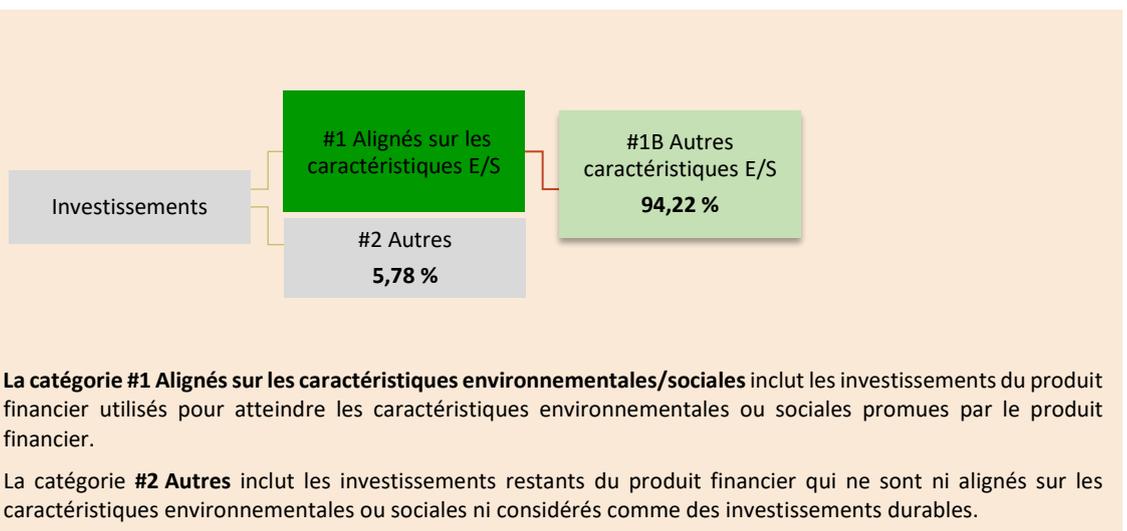
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Research Focused Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Research Focused Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 98,82 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Research Focused Fund ; les investissements restants (1,18 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et des instruments assimilés ; 95,34 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Research Focused Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 94,22 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 5,78 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologie	27,62
Biens d'équipement	17,40
Services financiers	15,86
Soins de santé	11,31
Biens de consommation cyclique	10,67
Énergie	7,75
Biens de consommation courante	5,91
Télécoms / télévision par câble	2,21
Liquidités et instruments assimilés	0,98

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

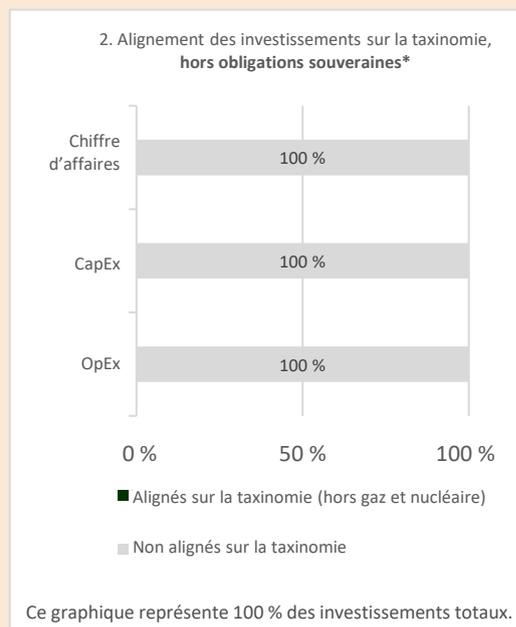
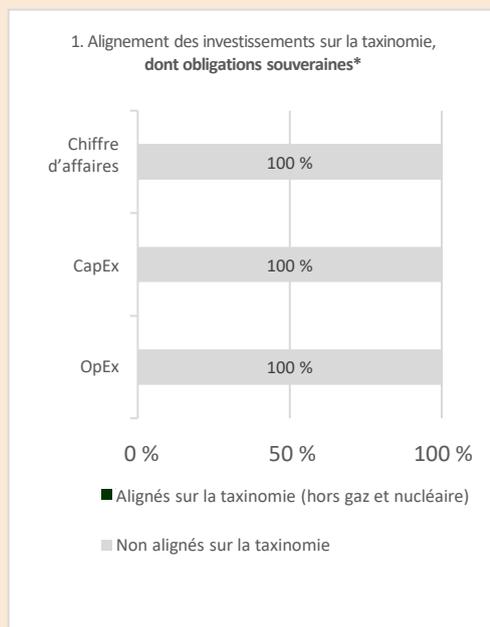
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Research Focused Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non. Le MFS Global Research Focused Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS Global Research Focused Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Research Focused Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Research Focused Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

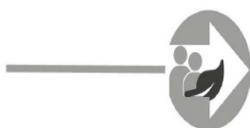
Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

 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 de la taxinomie de l'UE.



Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Research Focused Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 6 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Becton Dickinson & Co, ConocoPhillips, Diageo PLC, Iberdrola SA, Schneider Electric SE et Woodside Energy Group Ltd. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Schneider Electric SE, Canadian Pacific Kansas City Limited et TotalEnergies SE. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Wells Fargo & Company, Honeywell International Inc., Amazon.com, Inc. et Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Wells Fargo & Company, The Goldman Sachs Group, Inc, Chubb Limited, Amazon.com, Inc., TotalEnergies SE et Microsoft Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales 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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Global Strategic Equity Fund (« MFS Global Strategic Equity Fund »)

Identifiant d'entité juridique : 549300CC00Z25I4TJK84

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

À compter du 31 mai 2022, le MFS Global Strategic Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Strategic Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 87,01 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Strategic Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 85,98 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,81 % de l'actif du MFS Global Strategic Equity Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	60,29	59,57
31 janvier 2023	66,53	65,88
30 avril 2022	74,94	74,39

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	75,85	74,95
31 janvier 2023	73,79	73,07
30 avril 2022	59,07	58,63

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 avril 2022	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	87,01	85,98
31 janvier 2023	89,05	88,18
30 avril 2022	83,77	83,14



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Strategic Equity Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Strategic Equity Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	7,39	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	6,10	États-Unis
NVIDIA Corp	Technologies de l'information	5,18	États-Unis
Amazon.com Inc	Biens de consommation discrétionnaire	4,54	États-Unis
Mastercard Inc	Finance	3,95	États-Unis
Novo Nordisk AS	Soins de santé	3,92	Danemark
Linde PLC	Matériaux	3,60	États-Unis
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	3,38	France
MSCI Inc	Finance	3,34	États-Unis
Wolters Kluwer NV	Industrie	3,04	Pays-Bas
Boston Scientific Corp	Soins de santé	2,81	États-Unis
CoStar Group Inc	Immobilier	2,81	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 12 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



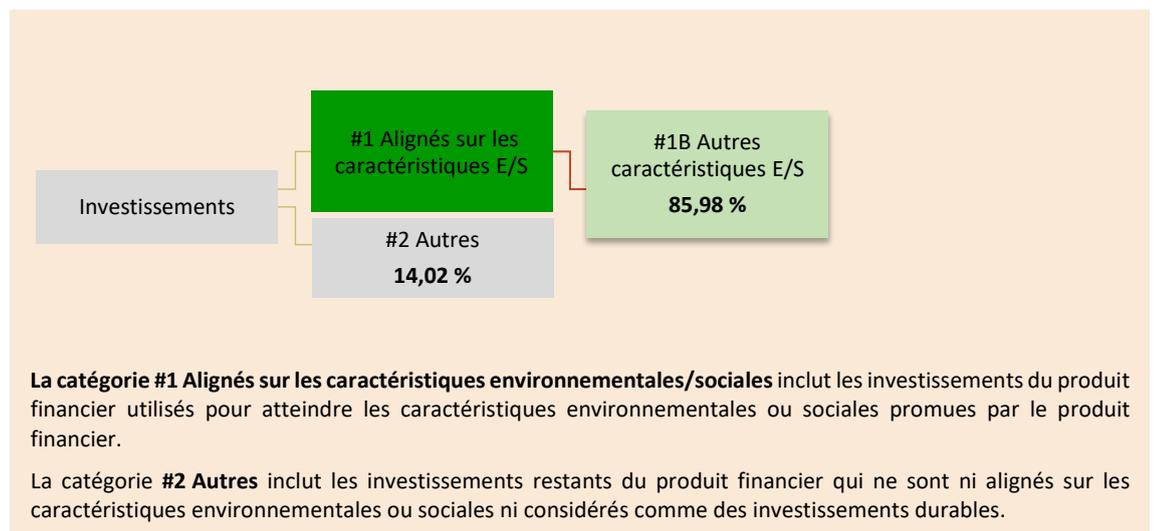
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Strategic Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Strategic Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 98,81 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Strategic Equity Fund ; les investissements restants (1,19 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 87,01 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Strategic Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 85,98 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 14,02 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologies de l'information	29,22
Industrie	14,19
Soins de santé	12,58
Finance	10,83
Biens de consommation discrétionnaire	9,68
Services de communication	9,44
Matériaux	6,04
Biens de consommation courante	5,54
Immobilier	1,39
Liquidités et instruments assimilés	0,63
Autre	0,05

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



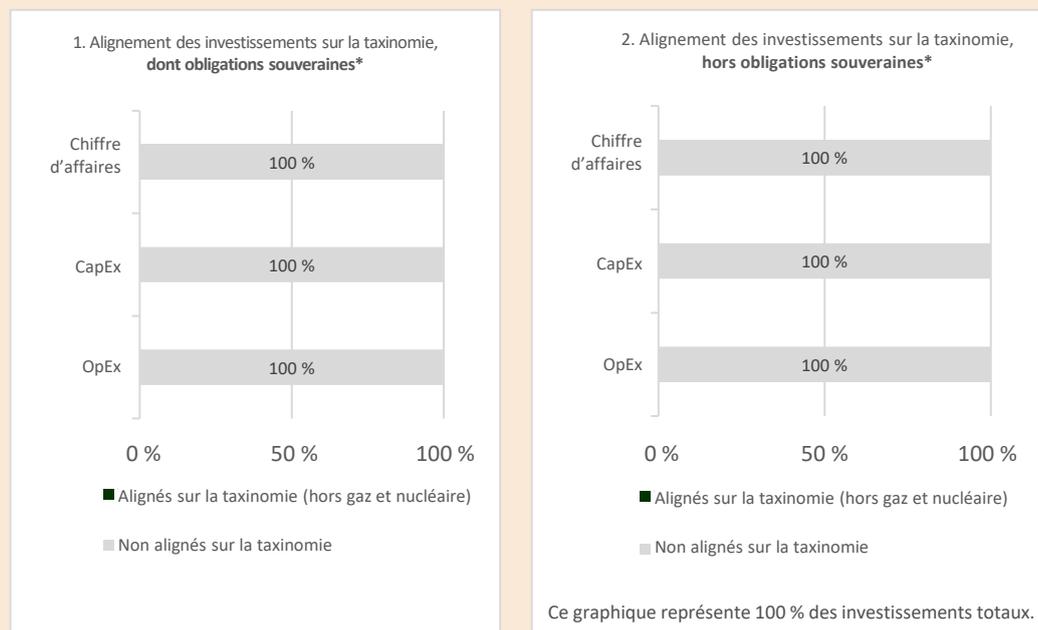
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Strategic Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non. Le MFS Global Strategic Equity Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

- Zéro. Le MFS Global Strategic Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.
- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 avril 2022	0 %	0 %	0 %

 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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Strategic Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Strategic Equity Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».

- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l’objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l’équipe d’investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d’autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d’exemple, les membres de l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l’équipe d’investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d’engagement auprès de plusieurs sociétés, et l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d’étape au titre de l’initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d’informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d’évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l’informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l’équipe d’investissement de MFS d’améliorer le recueil et l’évaluation des données ESG. En 2023, l’équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l’équipe d’investissement de MFS d’évaluer la performance climatique d’une entreprise ou d’un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d’informations essentielles à l’évaluation de l’alignement sur l’objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l’équipe d’investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l’ensemble de l’équipe d’investissement sur différents aspects de la recherche et de l’analyse liées au climat. À titre d’exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l’alignement sur l’initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l’équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l’approvisionnement en hydrogène. En outre, l’équipe d’investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Strategic Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l’investissement de MFS ont mené au moins 4 initiatives d’engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Schneider Electric SE, Thermo Fisher Scientific Inc et Vulcan Materials Co. Parmi les sujets abordés, citons l’identification du risque lié au changement climatique. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Schneider Electric SE et Canadian Pacific Kansas City Limited. Les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d’actionnaires liées au climat de l’émetteur suivant au cours de la période sous revue : Amazon.com, Inc. et Alphabet Inc. Les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d’actionnaires liées au climat de l’émetteur suivant au cours de la période sous revue : Amazon.com, Inc. CoStar Group, Inc, Microsoft Corporation et Intuit Inc.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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 : MFS Meridian Funds – Global Total Return Fund (« MFS Global Total Return Fund »)
Identifiant d'entité juridique : 1RDQ67M094ZPUN2RRO1

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui **No**

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/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 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 dans lesquelles le produit financier investit 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 ?

À compter du 21 juillet 2022, le MFS Global Total Return Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Global Total Return Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation et au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille (selon le cas) dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des quatre critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 90,39 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Total Return Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 54,96 % de l'actif total ; 76,70 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Total Return Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 9,35 % de l'actif total. Les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 60,81 % et 12,19 % de l'actif du MFS Global Total Return Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les indicateurs de durabilité

mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation et de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de participation et de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	78,84	47,94
31 janvier 2023	66,12	39,22
30 juin 2022	69,44	41,02

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	66,69	8,13
31 janvier 2023	59,75	7,05
30 juin 2022	62,51	3,55

Critère climatique 2 – mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	61,00	37,09
31 janvier 2023	58,24	34,54
30 juin 2022	8,30	4,90

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	34,86	4,25
31 janvier 2023	32,12	3,79
30 juin 2022	30,14	7,37

Critère climatique 3 – mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 juin 2022	0	0

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 juin 2022	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	5,33	0,65
31 janvier 2023	5,68	0,67
30 juin 2022	5,25	0,62

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	90,39	54,96
31 janvier 2023	83,01	49,24
30 juin 2022	73,33	43,23

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	76,70	9,35
31 janvier 2023	73,98	8,73
30 juin 2022	72,72	8,57

● **et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Global Total Return Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Global Total Return Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

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 problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Comcast Corp	Services de communication	1,29	États-Unis
Roche Holding AG	Soins de santé	1,28	Suisse
Johnson & Johnson	Soins de santé	1,20	États-Unis
Obligations du Trésor coréen, 1.875 %, 10 juin 29	Marchés émergents	1,07	Corée du Sud
BNP Paribas SA	Finance	1,01	France
UBS Group AG	Finance	1,00	Suisse
Obligation du Trésor japonais à 20 ans, 2,4 %, 20 juin 28	Hors marché américain	0,97	Japon
Aon PLC	Finance	0,94	États-Unis
Cigna Group	Soins de santé	0,88	États-Unis
Goldman Sachs Group Inc	Finance	0,83	États-Unis
IRS en USD à 2 ans, receveur, 3,412, 18 juin 27	Emprunts d'État américains	0,82	États-Unis
JPMorgan Chase & Co	Finance	0,81	États-Unis
Obligations du Trésor espagnol, 3,15 %, 30 avril 33	Hors marché américain	0,80	Espagne
Charles Schwab Corp	Finance	0,79	États-Unis
Omnicom Group Inc	Services de communication	0,78	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

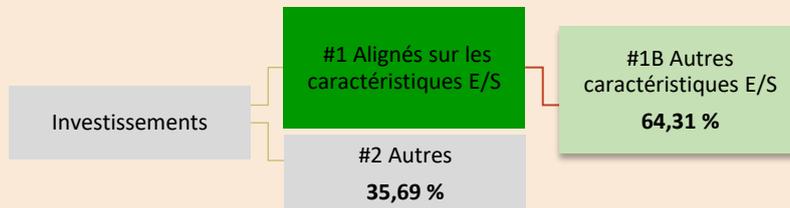


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Global Total Return Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation et 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Global Total Return Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 60,81 % et 12,19 % de l'actif total du portefeuille du MFS Global Total Return Fund ; les investissements restants (27,00 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 90,39 % des titres de participation du portefeuille du MFS Global Total Return Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 54,96 % de l'actif total du portefeuille ; 76,70 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Global Total Return Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 9,35 % de l'actif total du portefeuille ; 64,31 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 35,69 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Finance	13,26
Créances d'entreprises	12,21
Hors marché américain	10,70
Industrie	8,71
Soins de santé	7,96
Marchés émergents	7,24
Biens de consommation courante	6,63
Technologies de l'information	6,33
Titres adossés à des créances hypothécaires	4,52
Énergie	4,31

Services de communication	4,30
Emprunts d'État américains	3,64
Matériaux	3,22
Biens de consommation discrétionnaire	2,66
Services publics	2,24
Liquidités et instruments assimilés	1,50
Obligations titrisées (CDO)	1,36
Obligations municipales	0,66
Titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	0,43
Immobilier	0,35
Titres adossés à des actifs	0,27
Obligations convertibles	0,04
Agences	0,01
Autre	-2,47

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Total Return Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

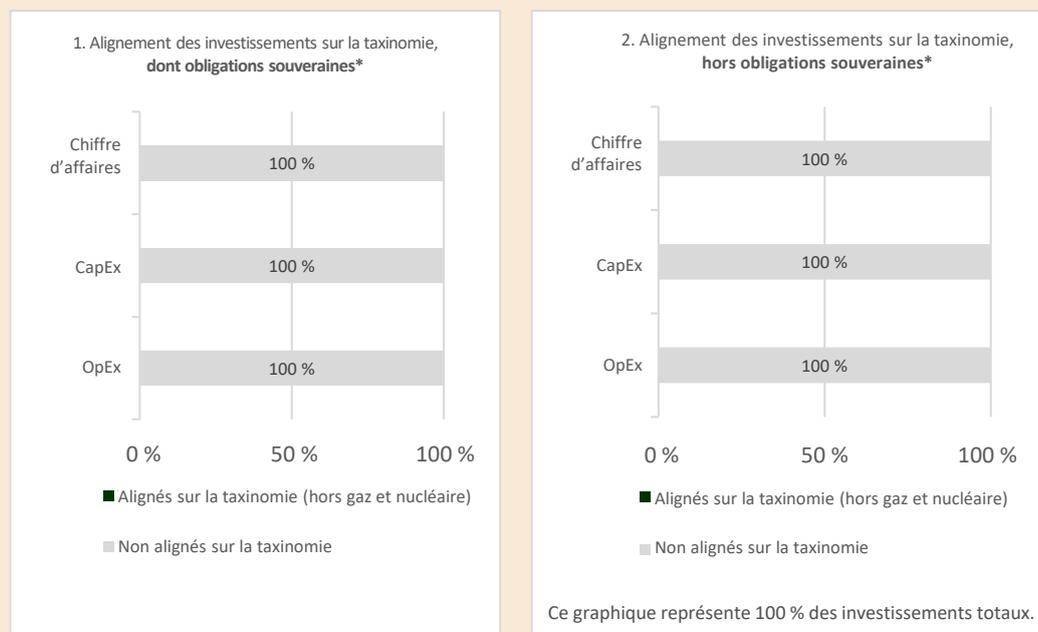
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Global Total Return Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Global Total Return Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 juin 2022	0 %	0 %	0 %

 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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Global Total Return Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation et les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Global Total Return Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Global Total Return Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 32 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : APA Group, Bank of America Corp, Becton Dickinson & Co, Cboe Global Markets Inc, ConocoPhillips, Diageo PLC, Duke Energy Corp, E.ON SE, Edison International, Enel SpA, Engie SA, Erste Group Bank AG, Glencore PLC, Iberdrola SA, National Grid PLC, Omnicom Group Inc, PPG Industries Inc, RAC Bond Co PLC, Samsung Electronics Co Ltd, Schneider Electric SE, Southern Co, Suncor Energy Inc, Thermo Fisher Scientific Inc, United Parcel Service Inc, Valero Energy Corp, Volkswagen AG, Vulcan Materials Co et Westinghouse Air Brake Technologies Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque physique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : UBS Group AG, Schneider Electric SE, Canadian Pacific Kansas City Limited et TotalEnergies SE. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Glencore Plc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Coterra Energy Inc, Texas Roadhouse, Inc, Honeywell International Inc, Exxon Mobil Corporation et Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Bank of America, The Goldman Sachs Group, Inc., Suncor Energy Inc, Valero Energy Corporation, JPMorgan Chase & Co, Chubb Limited, The Hartford Financial Services Group, Inc, The Travelers Companies, Inc, Glencore Plc, TotalEnergies SE, Exxon Mobil Corporation, Alphabet Inc, Comcast Corporation, Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc et Microsoft Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Limited Maturity Fund (« **MFS Limited Maturity Fund** »)
Identifiant d'entité juridique : H22Q4XW7UTNWFDP0PD4

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-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** : _____ %

No

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 21 juillet 2022, le MFS Limited Maturity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Limited Maturity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 85,04 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Limited Maturity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 44,23 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 52,01 % de l'actif du MFS Limited Maturity Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	76,47	39,77
31 janvier 2023	66,95	37,22
30 juin 2022	70,45	39,60

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	28,80	14,98
31 janvier 2023	29,48	16,39
30 juin 2022	30,68	17,24

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 juin 2022	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	1,14	0,59
31 janvier 2023	1,57	0,87
30 juin 2022	1,58	0,89

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2, 3 et/ou 4) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	85,04	44,23
31 janvier 2023	76,20	42,36
30 juin 2022	79,01	44,41

... et par rapport aux périodes précédentes ?

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

S/O.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Limited Maturity Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions

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.

d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Limited Maturity Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « Indicateurs d'émissions supplémentaires »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Bon du Trésor américain, 3,875 %, 15 janvier 26	Gouvernement	7,21	États-Unis
IRS en USD à 3 ans, receveur, 4,967, 02 octobre 26	Gouvernement	6,49	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,75 %, 15 mai 25	Gouvernement	6,17	États-Unis
Bon du Trésor américain, 5 %, 30 septembre 25	Gouvernement	4,02	États-Unis
Bon du Trésor américain, 4,125 %, 31 janvier 25	Gouvernement	3,58	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 29 septembre 23	Gouvernement	2,19	États-Unis
IRS en USD à 3 ans, receveur, 4,120, 16 juin 26	Gouvernement	1,96	États-Unis
Bon du Trésor américain, 4,5 %, 15 juillet 26	Gouvernement	1,90	États-Unis
IRS en USD à 3 ans, receveur, 3,821, 06 décembre 25	Gouvernement	1,90	États-Unis
Bon du Trésor américain, 4,625 %, 15 novembre 26	Gouvernement	1,84	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 29 décembre 23	Gouvernement	1,68	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Bon du Trésor américain, 3,75 %, 15 avril 26	Gouvernement	1,63	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 28 mars 24	Gouvernement	1,50	États-Unis
IRS en USD à 2 ans, receveur, 5,014, 02 octobre 25	Gouvernement	1,05	États-Unis
Entergy Louisiana LLC, 0,95 %, 1er octobre 24	Entreprise	0,84	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

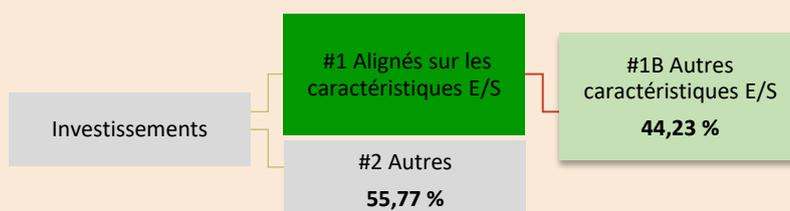


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Limited Maturity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Limited Maturity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 52,01 % de l'actif total du portefeuille du MFS Limited Maturity Fund ; les investissements restants (47,89 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des sociétés, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 85,04 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Limited Maturity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 44,23 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 55,77 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Trésor – bons du Trésor	26,38
Sociétés privées – industrie	25,13
Sociétés privées – établissements financiers	24,43
Titrisation – obligations de prêts garantis	12,47
Produits dérivés – négociés en bourse	5,89
Sociétés privées – services publics	4,17
Liquidités – Liquidités	3,26
Titrisation – titres adossés à des actifs	1,55
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	0,65
Gouvernement – agences gouvernementales	0,54
Titrisation – obligation hypothécaire garantie	0,50
Gouvernement – titres souverains liés à un État	0,44
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,27
Obligations municipales – obligations fiscales spéciales	0,14
Obligations municipales – autres	0,14
Obligations municipales – éducation	0,14
Obligations municipales – location	0,10
Produits dérivés – de gré à gré	0,08
Obligations municipales – logement	0,07
Obligations municipales – Obligation à revenu pour le développement industriel	0,07
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires avec flux identiques	0,07

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Limited Maturity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Limited Maturity Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

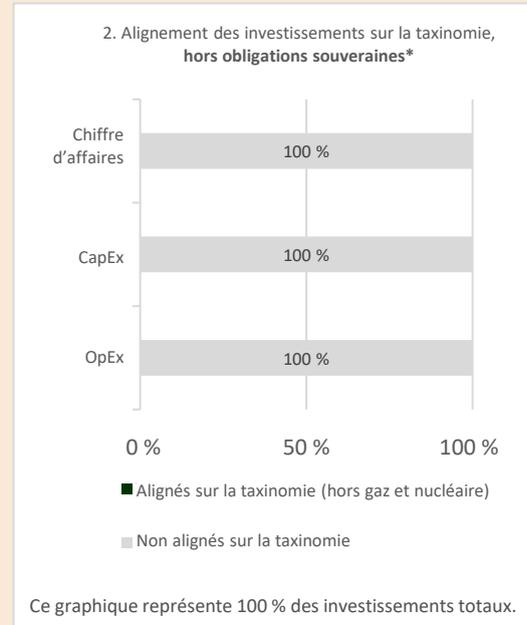
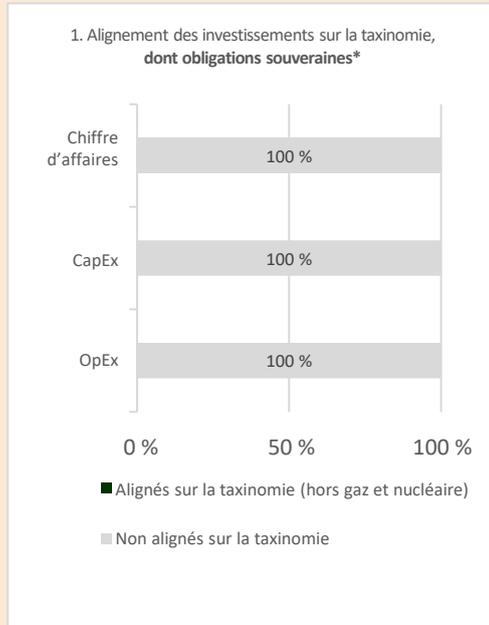
Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Limited Maturity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 juin 2022	0 %	0 %	0 %

 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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Limited Maturity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Limited Maturity Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements - MFS Limited Maturity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 12 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : APA Group, Bank of America Corp, Edison International, Enel SpA, Glencore PLC, Plains All American Pipeline LP, Thermo Fisher Scientific Inc, Toronto-Dominion Bank, Volkswagen AG et Westinghouse Air Brake Technologies Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque physique, le risque de transition et les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi).



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – Managed Wealth Fund (« MFS Managed Wealth Fund »)
Identifiant d'entité juridique : 222100EEEJHVDAVX719

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



À compter du 21 juillet 2022, le MFS Managed Wealth Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Managed Wealth Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 89,70 % des titres de participation du portefeuille du MFS Managed Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 81,23 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 90,55 % de l'actif du MFS Managed Wealth Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	73,84	66,86
31 janvier 2023	68,82	63,89
30 juin 2022	69,05	57,29

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	66,02	59,78
31 janvier 2023	62,96	58,45
30 juin 2022	8,92	7,40

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 juin 2022	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	89,70	81,23
31 janvier 2023	86,78	80,57
30 juin 2022	81,26	59,12



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Managed Wealth Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Managed Wealth Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	4,15	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	1,82	États-Unis
Amazon.com Inc	Biens de consommation discrétionnaire	1,80	États-Unis
Apple Inc	Technologies de l'information	1,80	États-Unis
NVIDIA Corp	Technologies de l'information	1,57	États-Unis
Nestle SA	Biens de consommation courante	1,52	Suisse
JPMorgan Chase & Co	Finance	1,22	États-Unis
Mastercard Inc	Finance	1,17	États-Unis
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Biens de consommation discrétionnaire	1,16	France
Aon PLC	Finance	1,06	États-Unis
Visa Inc	Finance	0,98	États-Unis
Air Liquide SA	Matériaux	0,93	France
Linde PLC	Matériaux	0,90	États-Unis
Boston Scientific Corp	Soins de santé	0,89	États-Unis
Schneider Electric SE	Industrie	0,88	France

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

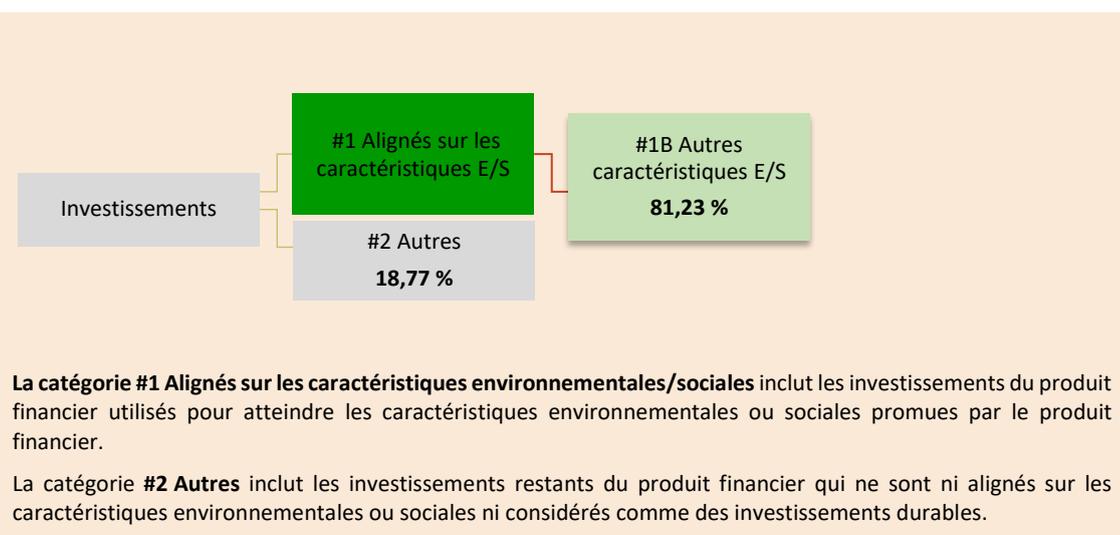


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Managed Wealth Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Managed Wealth Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 90,55 % de l'actif total du portefeuille du MFS Managed Wealth Fund ; les investissements restants (9,45 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 89,70 % des titres de participation du portefeuille du MFS Managed Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 81,23 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 18,77 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Autre	54,28
Technologies de l'information	17,48
Finance	15,74
Soins de santé	13,18
Industrie	13,04
Biens de consommation discrétionnaire	7,90
Liquidités et instruments assimilés	7,55
Biens de consommation courante	6,30

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Services de communication	5,10
Matériaux	4,86
Services publics	2,65
Énergie	2,58
Immobilier	0,92
Options sur indices	-1,51
Contrats à terme standardisés sur indices	-72,80

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Managed Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

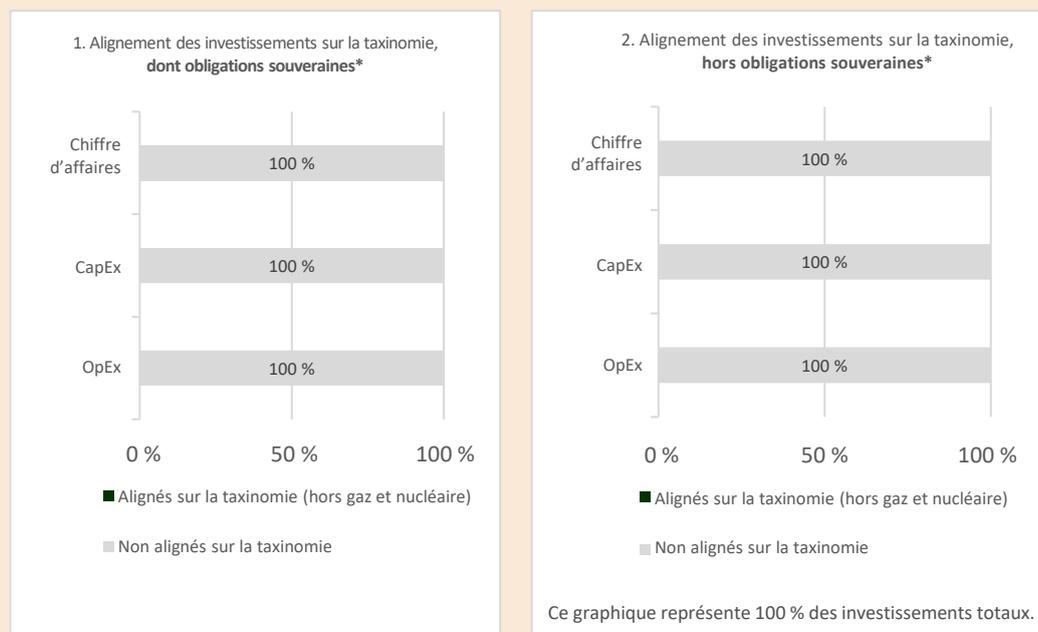
Non. Le MFS Managed Wealth Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Managed Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 juin 2022	0 %	0 %	0 %

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 de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS Managed Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Managed Wealth Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Vote par procuration - MFS Managed Wealth Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : UBS Group AG, Canadian National Railway Company, Schneider Electric SE et Canadian Pacific Kansas City Limited. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : PACCAR Inc, Public Storage, Raytheon Technologies Corporation, Martin Marietta Materials, Inc, Honeywell International Inc, Amazon.com, Inc. et Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : The Toronto-Dominion Bank, Citigroup Inc, ENGIE SA, The Goldman Sachs Group, Inc., PepsiCo, Inc, Duke Energy Corporation, Suncor Energy Inc, JPMorgan Chase & Co, Chubb Limited, Morgan Stanley, Amazon.com, Inc, BlackRock, Inc, The Southern Company, The Travelers Companies, Inc, Comcast Corporation, CoStar Group Inc, Caterpillar Inc, Microsoft Corporation et Intuit Inc.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales 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 : MFS Meridian Funds – Prudent Capital Fund (« MFS Prudent Capital Fund »)
Identifiant d'entité juridique : 222100FL6ZWWC5ZUHJ09

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 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 dans lesquelles le produit financier investit 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 ?

À compter du 31 décembre 2021, le MFS Prudent Capital Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Prudent Capital Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation et au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille (selon le cas) dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des quatre critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 72,93 % des titres de participation du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 38,61 % de l'actif total ; 45,43 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 5,47 % de l'actif total. Les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 52,93 % et 12,04 % de l'actif du MFS Prudent Capital Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation et de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de participation et de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	46,61	24,67
31 janvier 2023	46,45	27,35
30 novembre 2021	66,76	32,23

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	35,47	4,27
31 janvier 2023	52,77	5,77
30 novembre 2021	29,9	3,02

Critère climatique 2 – mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	63,76	33,75
31 janvier 2023	61,28	36,08
30 novembre 2021	52,30	25,27

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	24,25	2,92
31 janvier 2023	23,71	2,57
30 novembre 2021	9,60	0,97

Critère climatique 3 – mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	5,90	0,71
31 janvier 2023	6,09	0,66
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	72,93	38,61
31 janvier 2023	68,64	40,42
30 novembre 2021	80,16	38,70

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2, 3 et/ou 4) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	45,43	5,47
31 janvier 2023	62,92	6,82
30 novembre 2021	34,6	3,50

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Prudent Capital Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Prudent Capital Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

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 problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Bon du Trésor américain, 3 %, 30 juin 24	Emprunts d'État américains	3,63	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,25 %, 31 mars 24	Emprunts d'État américains	3,52	États-Unis
LEG Immobilien SE	Immobilier	3,48	Allemagne
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	2,81	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,625 %, 31 décembre 23	Emprunts d'État américains	2,79	États-Unis
Bons du Trésor américain indexés sur l'inflation, 0,5 %, 15 avril 24	Emprunts d'État américains	2,74	États-Unis
iShares Physical Gold ETC ETF	ETF	2,55	Irlande
Bons du Trésor américain indexés sur l'inflation, 0,125 %, 15 avril 27	Emprunts d'État américains	2,43	États-Unis
Samsung Electronics Co Ltd	Technologies de l'information	2,17	Corée du Sud
Bon du Trésor américain, 4,25 %, 30 septembre 24	Emprunts d'État américains	2,06	États-Unis
Amadeus IT Group SA	Biens de consommation discrétionnaire	1,91	Espagne
Heineken Holding NV	Biens de consommation courante	1,91	Pays-Bas
Booking Holdings Inc	Biens de consommation discrétionnaire	1,88	États-Unis
Bon du Trésor américain, 1,375 %, 30 septembre 23	Emprunts d'État américains	1,85	États-Unis
Nintendo Co Ltd	Services de communication	1,85	Japon

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



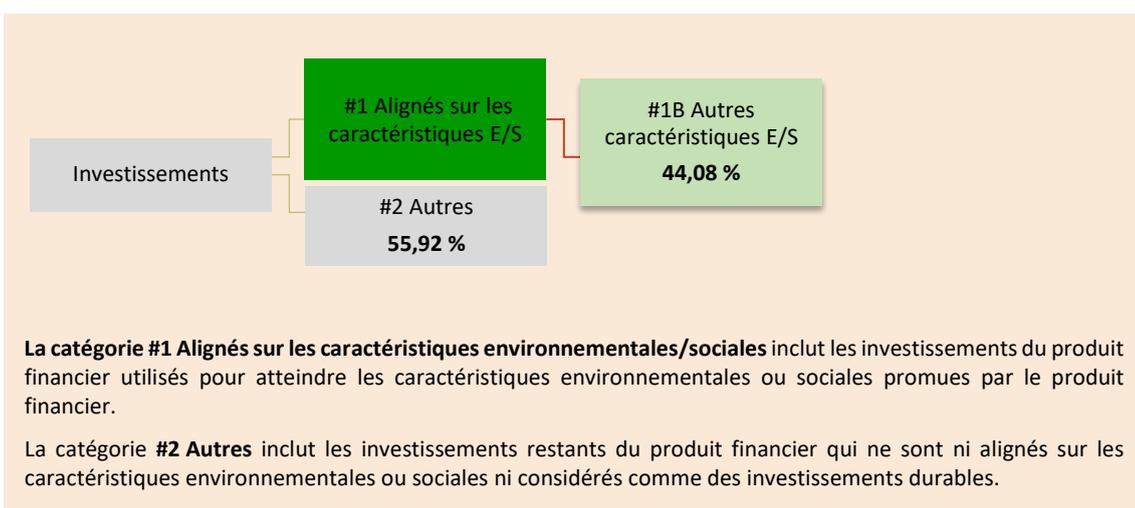
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Prudent Capital Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation et 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Prudent Capital Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 52,93 % et 12,04 % de l'actif total du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund ; les investissements restants (35,03 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 72,93 % des titres de participation du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 38,61 % de l'actif total du portefeuille ; 45,43 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Prudent Capital Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 5,47 % de l'actif total du portefeuille ; 44,08 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 55,92 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Emprunts d'État américains	22,96
Technologies de l'information	11,35
Services de communication	11,26
Créances d'entreprises	9,83

Industrie	8,65
Autre	5,89
Immobilier	5,81
Liquidités et instruments assimilés	4,50
Biens de consommation discrétionnaire	4,36
Finance	3,21
ETF	3,16
Soins de santé	2,89
Biens de consommation courante	2,85
Titres adossés à des créances hypothécaires	2,48
Marchés émergents	1,88
Services publics	1,73
Matériaux	1,26
Titres adossés à des actifs	0,27
Options sur actions	-0,57
Contrats à terme standardisés sur indices	-2,71
Options sur indices	-3,92

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Prudent Capital Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui :

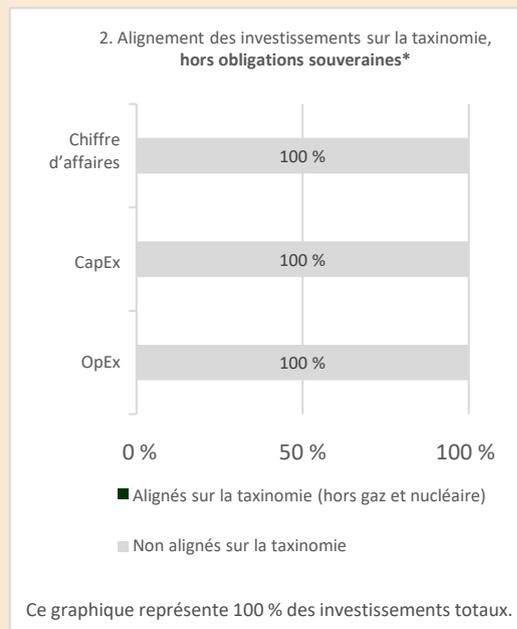
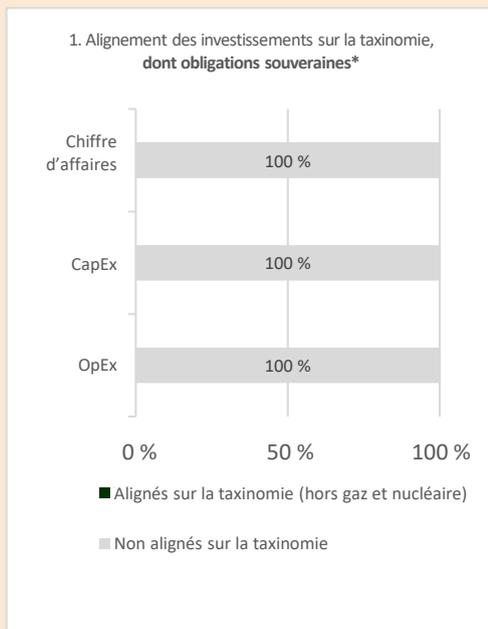
Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Prudent Capital Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Prudent Capital Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS Prudent Capital Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

S/O.

 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 de la taxinomie de l'UE.**





Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation et les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Prudent Capital Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Prudent Capital Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 4 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Iberdrola SA, RAC Bond Co PLC, Samsung Electronics Co Ltd et Southern Co. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Microsoft Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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 : MFS Meridian Funds – Prudent Wealth Fund (« MFS Prudent Wealth Fund »)
Identifiant d'entité juridique : 549300LM7K1F8VSRZS66

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 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 dans lesquelles le produit financier investit 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 ?

À compter du 31 décembre 2021, le MFS Prudent Wealth Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS Prudent Wealth Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation et au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille (selon le cas) dans des émetteurs qui répondent, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des quatre critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 68,53 % des titres de participation du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 43,63 % de l'actif total ; 60,14 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 0,86 % de l'actif total. Les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 63,67 % et 1,43 % de l'actif du MFS Prudent Wealth Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité des émissions de gaz à effet de serre (« GES ») des émetteurs de titres de participation et de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de participation et de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	44,14	28,10
31 janvier 2023	39,18	26,45
30 novembre 2021	67,01	37,0

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	60,14	0,86
31 janvier 2023	100	1,14
30 novembre 2021	100	0,90

Critère climatique 2 – mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	58,86	37,48
31 janvier 2023	54,86	37,04
30 novembre 2021	43,80	24,20

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	4,90	0,07
31 janvier 2023	30,70	0,35
30 novembre 2021	33,1	0,28

Critère climatique 3 – mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation et des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	68,53	43,63
31 janvier 2023	60,92	41,12
30 novembre 2022	76,12	42,03

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2, 3 et/ou 4) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	60,14	0,86
31 janvier 2023	100	1,14
30 novembre 2022	100	0,90



... et par rapport aux périodes précédentes ?

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Sans objet.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS Prudent Wealth Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS Prudent Wealth Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

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 problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Bon du Trésor américain, 3 %, 30 juin 24	Emprunts d'État américains	3,58	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,25 %, 31 mars 24	Emprunts d'État américains	3,44	États-Unis
LEG Immobilien SE	Immobilier	3,22	Allemagne
Bons du Trésor américain indexés sur l'inflation, 0,5 %, 15 avril 24	Emprunts d'État américains	2,77	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,625 %, 31 décembre 23	Emprunts d'État américains	2,76	États-Unis
iShares Physical Gold ETC ETF	ETF	2,74	Irlande
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	2,44	États-Unis
Bons du Trésor américain indexés sur l'inflation, 0,125 %, 15 avril 27	Emprunts d'État américains	2,44	États-Unis
Bon du Trésor américain, 4,25 %, 30 septembre 24	Emprunts d'État américains	2,05	États-Unis
Samsung Electronics Co Ltd	Technologies de l'information	1,88	Corée du Sud
Bon du Trésor américain, 1,375 %, 30 septembre 23	Emprunts d'État américains	1,83	États-Unis
Heineken Holding NV	Biens de consommation courante	1,80	Pays-Bas
J D Wetherspoon PLC	Biens de consommation discrétionnaire	1,76	Royaume-Uni
Iberdrola SA	Services publics	1,68	Espagne
KDDI Corp	Services de communication	1,68	Japon

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

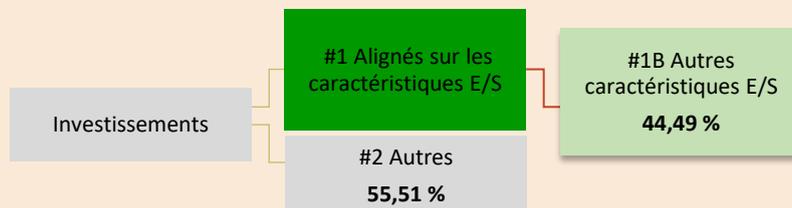


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS Prudent Wealth Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation et 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS Prudent Wealth Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation et les titres de créance d'entreprises représentaient, respectivement, 63,67 % et 1,43 % de l'actif total du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund ; les investissements restants du portefeuille comprenaient des titres de créance non émis par des entreprises, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 68,53 % des titres de participation du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 43,63 % de l'actif total du portefeuille ; 60,14 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS Prudent Wealth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 0,86 % de l'actif total du portefeuille ; 44,49 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 55,51 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting. Les pourcentages de titres de créance d'entreprises figurant dans le présent rapport incluent tous les montants d'intérêts courus.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Emprunts d'État américains	22,84
Technologies de l'information	11,32
Services de communication	10,63
Industrie	9,90
Immobilier	9,61
Autre	8,38
Biens de consommation discrétionnaire	6,24
Liquidités et instruments assimilés	4,65
Finance	4,32

Biens de consommation courante	3,82
Soins de santé	3,37
ETF	3,26
Matériaux	2,88
Titres adossés à des créances hypothécaires	2,51
Services publics	1,68
Créances d'entreprises	1,16
Titres adossés à des actifs	0,18
Options sur actions	-0,57
Contrats à terme standardisés sur indices	-3,02
Options sur indices	-6,38

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS Prudent Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

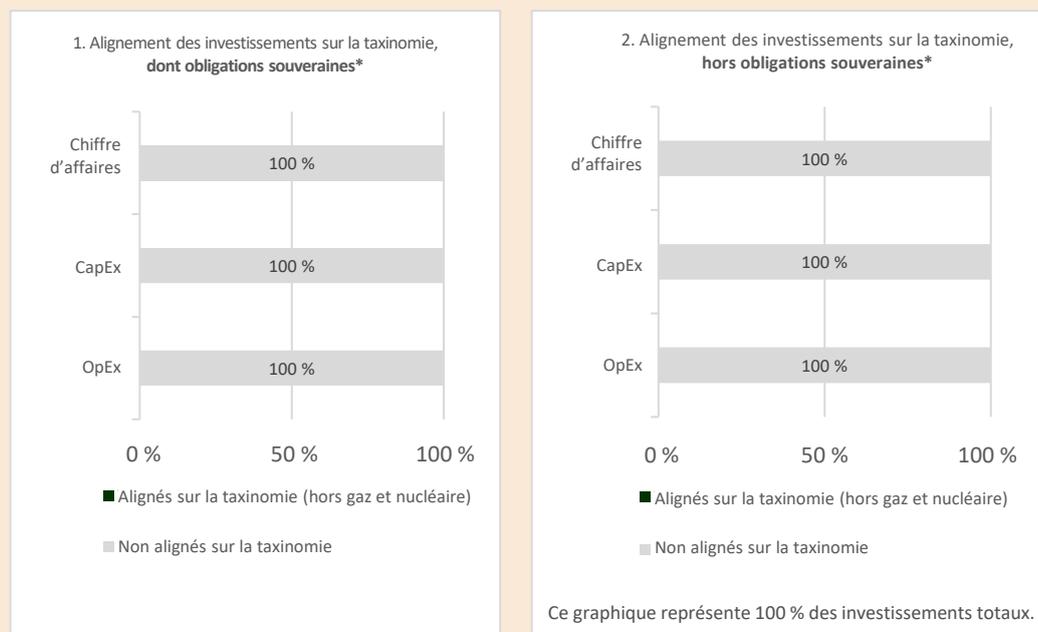
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS Prudent Wealth Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS Prudent Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

 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 de la taxinomie de l'UE.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS Prudent Wealth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation et les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS Prudent Wealth Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS Prudent Wealth Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 3 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Iberdrola SA, Samsung Electronics Co Ltd et Southern Co. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Alphabet Inc. Les professionnels de l'investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d'actionnaires liées au climat de l'émetteur suivant au cours de la période sous revue : Microsoft Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.K. Equity Fund (« **MFS U.K. Equity Fund** »)
Identifiant d'entité juridique : DAPX7647TOH0KQ40FF91

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



À compter du 31 décembre 2021, le MFS U.K. Equity Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.K. Equity Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 95,87 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.K. Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 94,86 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 98,94 % de l'actif du MFS U.K. Equity Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	88,39	87,46
31 janvier 2023	73,96	73,49
30 novembre 2021	74,09	72,80

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	69,36	68,63
31 janvier 2023	59,32	58,94
30 novembre 2021	51,80	50,89

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	95,87	94,86
31 janvier 2023	91,42	90,84
30 novembre 2021	88,62	87,07

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.



● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS U.K. Equity Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.K. Equity Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Shell PLC	Énergie	7,12	Royaume-Uni
AstraZeneca PLC	Soins de santé	5,68	Royaume-Uni
Diageo PLC	Biens de consommation courante	5,01	Royaume-Uni
RELX PLC	Industrie	4,74	Royaume-Uni
Glencore PLC	Matériaux	3,78	Royaume-Uni
NatWest Group PLC	Finance	3,29	Royaume-Uni
National Grid PLC	Services publics	3,23	Royaume-Uni
Experian PLC	Industrie	3,22	Royaume-Uni
Rio Tinto PLC	Matériaux	3,15	Royaume-Uni
Lloyds Banking Group PLC	Finance	3,15	Royaume-Uni
Reckitt Benckiser Group PLC	Biens de consommation courante	3,14	Royaume-Uni
Tesco PLC	Biens de consommation courante	3,07	Royaume-Uni
London Stock Exchange Group PLC	Finance	2,95	Royaume-Uni

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 13 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.



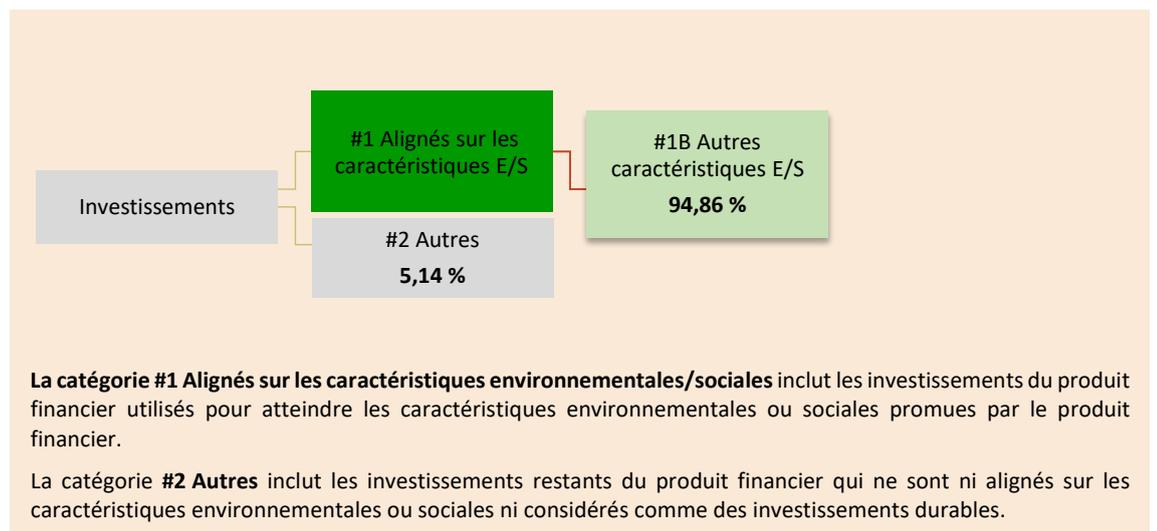
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS U.K. Equity Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.K. Equity Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs
décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 98,94 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.K. Equity Fund ; les investissements restants (1,06 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 95,87 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.K. Equity Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 94,86 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 5,14 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Biens de consommation courante	18,03
Finance	17,93
Industrie	14,31
Matériaux	10,72
Énergie	9,18
Biens de consommation discrétionnaire	8,64
Soins de santé	8,54
Services de communication	4,46
Services publics	3,23
Technologies de l'information	1,57
Immobilier	1,44
Liquidités et instruments assimilés	1,21

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

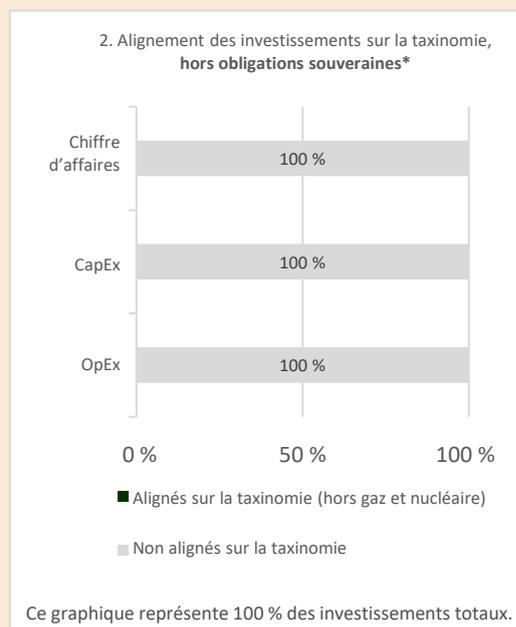
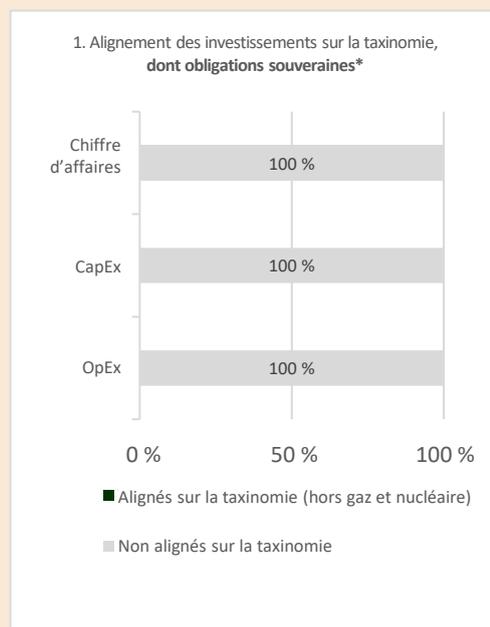
Zéro. Le MFS U.K. Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui : Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS U.K. Equity Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.



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

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.K. Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.K. Equity Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.K. Equity Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».

 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 de la taxinomie de l'UE.



- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l’objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l’équipe d’investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d’autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d’exemple, les membres de l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l’équipe d’investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d’engagement auprès de plusieurs sociétés, et l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d’étape au titre de l’initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d’informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d’évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l’informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l’équipe d’investissement de MFS d’améliorer le recueil et l’évaluation des données ESG. En 2023, l’équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l’équipe d’investissement de MFS d’évaluer la performance climatique d’une entreprise ou d’un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d’informations essentielles à l’évaluation de l’alignement sur l’objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l’équipe d’investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l’ensemble de l’équipe d’investissement sur différents aspects de la recherche et de l’analyse liées au climat. À titre d’exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l’alignement sur l’initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l’équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l’approvisionnement en hydrogène. En outre, l’équipe d’investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS U.K. Equity Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l’investissement de MFS ont mené au moins 6 initiatives d’engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Diageo PLC, Forterra PLC, Glencore PLC et National Grid PLC. Parmi les sujets abordés, citons l’identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l’analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Shell Plc. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Glencore Plc. Les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d’actionnaires liées au climat de l’émetteur suivant au cours de la période sous revue : Shell Plc and Glencore Plc.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Concentrated Growth Fund (« MFS U.S. Concentrated Growth Fund »)

Identifiant d'entité juridique : G651RPCOZ0VMJ132HI34

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Depuis le 31 décembre 2021, le MFS U.S. Concentrated Growth Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Concentrated Growth Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 96,53 % des titres de participation du portefeuille MFS U.S. Concentrated Growth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 96,23 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,68 % de l'actif du MFS U.S. Concentrated Growth Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	77,23	76,99
31 janvier 2023	77,45	76,87
30 novembre 2021	62,19	61,52

Critère climatique 2 – mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	77,40	77,15
31 janvier 2023	59,36	58,92
30 novembre 2021	52,80	52,20

Critère climatique 3 – mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	96,53	96,23
31 janvier 2023	90,08	89,41
30 novembre 2021	80,22	79,36

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.



● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Concentrated Growth Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Niveaux 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité des émissions de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de la consommation d'énergies non renouvelables et intensité de la production et de la consommation d'énergie par secteur climatique à fort impact** (ensemble, les « Indicateurs d'émissions supplémentaires »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	9,26	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	7,57	États-Unis
Visa Inc	Finance	6,62	États-Unis
Accenture PLC	Technologies de l'information	5,69	États-Unis
Aon PLC	Finance	5,27	États-Unis
Amphenol Corp	Technologies de l'information	4,49	États-Unis
Church & Dwight Co Inc	Biens de consommation courante	4,39	États-Unis
TJX Cos Inc	Biens de consommation discrétionnaire	4,24	États-Unis
Boston Scientific Corp	Soins de santé	3,36	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 9 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

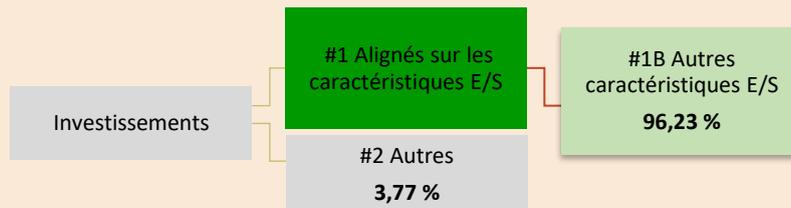
Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Concentrated Growth Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs

décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 99,68 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Concentrated Growth Fund ; les investissements restants (0,32 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 96,53 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Concentrated Growth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 96,23 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 3,77 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques environnementales/sociales** 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.

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologies de l'information	32,11
Soins de santé	15,52
Finance	14,16
Biens de consommation discrétionnaire	11,56
Biens de consommation courante	8,58
Services de communication	8,29
Industrie	4,42
Immobilier	2,83
Services publics	1,83
Liquidités et instruments assimilés	0,58

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



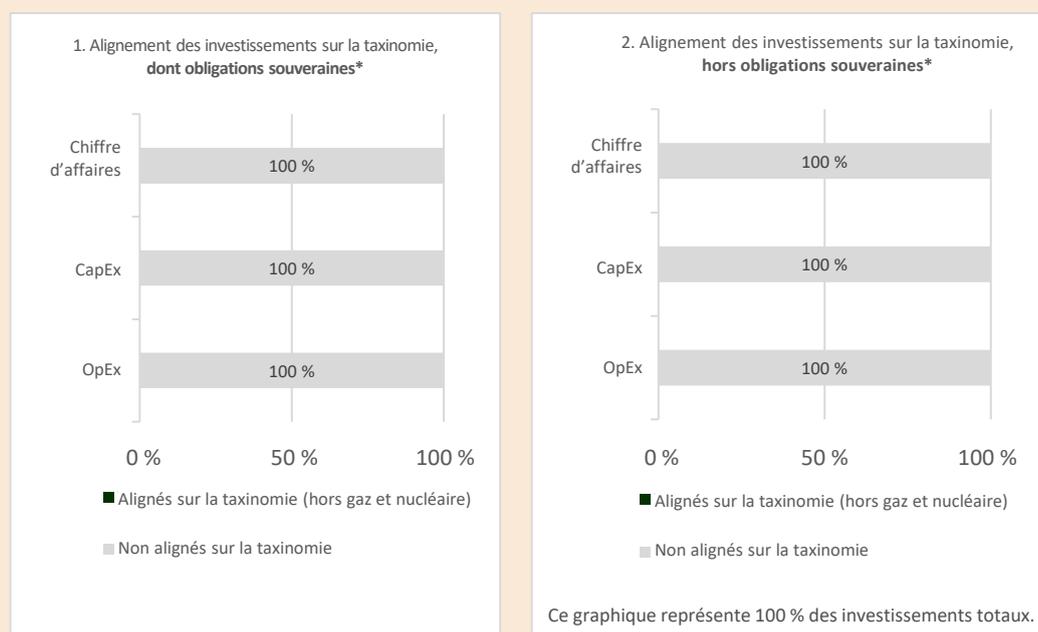
Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non. Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE, et il ne s'engage pas à le faire.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.S. Concentrated Growth Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».

 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 de la taxinomie de l'UE.



- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l’objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l’équipe d’investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d’autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d’exemple, les membres de l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l’équipe d’investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d’engagement auprès de plusieurs sociétés, et l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d’étape au titre de l’initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d’informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d’évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l’informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l’équipe d’investissement de MFS d’améliorer le recueil et l’évaluation des données ESG. En 2023, l’équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l’équipe d’investissement de MFS d’évaluer la performance climatique d’une entreprise ou d’un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d’informations essentielles à l’évaluation de l’alignement sur l’objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l’équipe d’investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l’ensemble de l’équipe d’investissement sur différents aspects de la recherche et de l’analyse liées au climat. À titre d’exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l’alignement sur l’initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l’équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l’approvisionnement en hydrogène. En outre, l’équipe d’investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Vote par procuration - MFS U.S. Concentrated Growth Fund

Les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d’actionnaires liées au climat de l’émetteur suivant au cours de la période sous revue : Alphabet Inc. Les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d’actionnaires liées au climat de l’émetteur suivant au cours de la période sous revue : Microsoft Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Corporate Bond Fund (« MFS U.S. Corporate Bond Fund »)
Identifiant d'entité juridique : 549300Y607X5WMN51U45

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



Depuis le 31 décembre 2021, le MFS U.S. Corporate Bond Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Corporate Bond Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 76,19 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS U.S. Corporate Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 67,35 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 88,40 % de l'actif du MFS U.S. Corporate Bond Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	67,84	59,96
31 janvier 2023	68,05	58,11
30 novembre 2021	68,17	63,25

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	29,24	25,84
31 janvier 2023	28,20	24,08
30 novembre 2021	28,51	26,45

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	2,17	1,91
31 janvier 2023	1,92	1,64
30 novembre 2021	2,21	2,05

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	76,19	67,35
31 janvier 2023	77,22	65,93
30 novembre 2022	81,39	75,51

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veuillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

S/O.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS U.S. Corporate Bond Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions

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.

d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Corporate Bond Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 29 septembre 23	Gouvernement	2,65	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 28 mars 24	Gouvernement	2,21	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 29 décembre 23	Gouvernement	2,06	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,375 %, 15 février 42	Gouvernement	1,67	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 30 juin 23	Gouvernement	1,65	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,625 %, 15 avril 25	Gouvernement	1,29	États-Unis
Bon du Trésor américain, 3,875 %, 15 mai 43	Gouvernement	1,15	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 20 septembre 23	Gouvernement	0,95	États-Unis
Bon du Trésor américain, 4,25 %, 31 décembre 24	Gouvernement	0,91	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 19 décembre 23	Gouvernement	0,73	États-Unis
JPMorgan Chase & Co, FRB, 08 novembre 32	Entreprise	0,67	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 21 juin 23	Gouvernement	0,64	États-Unis
Bank of America Corp, FRB, 27 avril 28	Entreprise	0,61	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,875 %, 15 mai 52	Gouvernement	0,60	États-Unis
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc., 1,71 %, 12 janvier 31	Entreprise	0,59	Japon

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



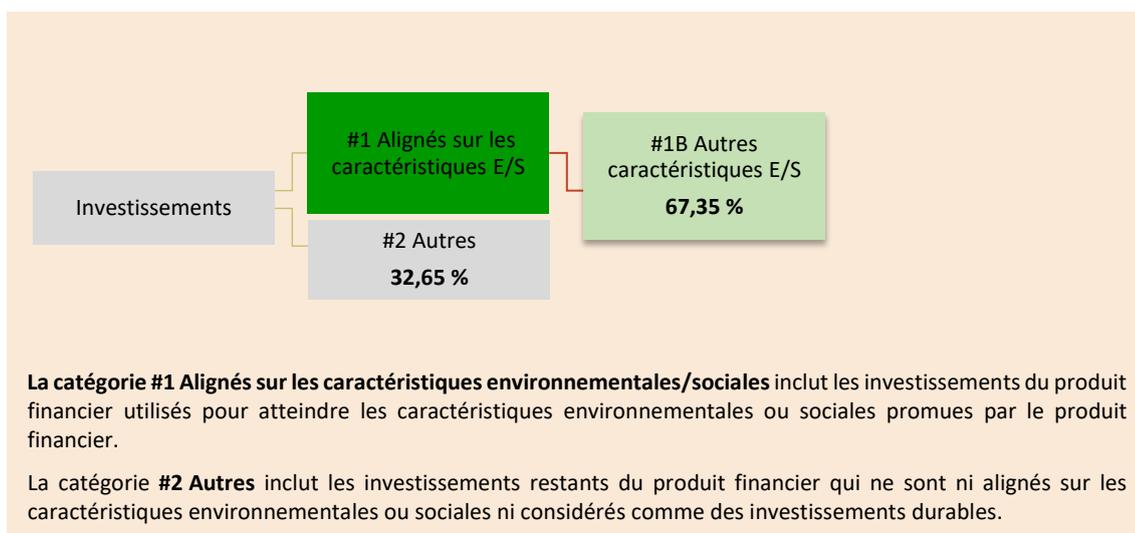
L'allocation des actifs décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Le MFS U.S. Corporate Bond Fund vise à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Corporate Bond Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 88,40 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Corporate Bond Fund ; les investissements restants (11,60 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des sociétés, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 76,19 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS U.S. Corporate Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 67,35 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 32,65 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Sociétés privées – industrie	48,48
Sociétés privées – établissements financiers	29,70
Sociétés privées – services publics	9,04
Trésor – bons du Trésor	6,94
Liquidités – Liquidités	2,63
Produits dérivés – négociés en bourse	1,52
Gouvernement – titres souverains liés à un État	0,96
Gouvernement – agences gouvernementales	0,88
Titrisation – obligations de prêts garantis	0,88
Titrisation – titres adossés à des actifs	0,32
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,25

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Corporate Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

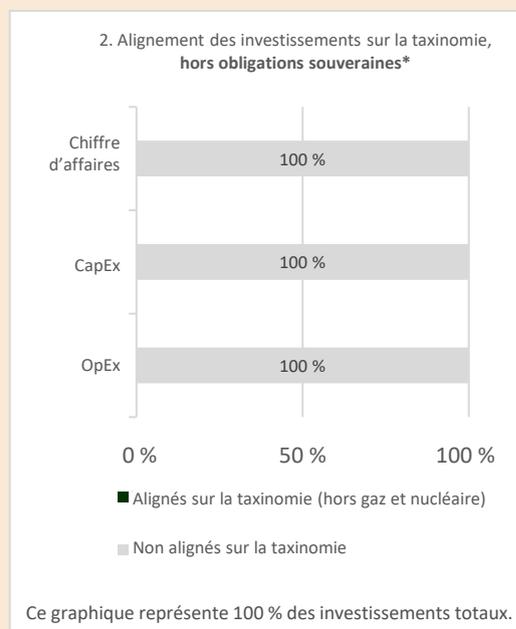
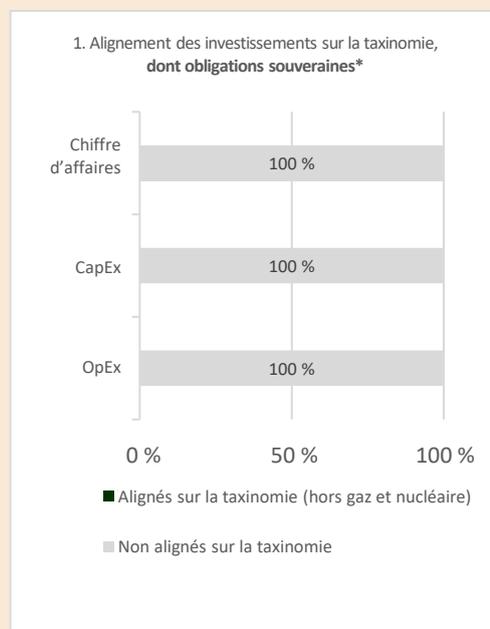
Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire

Non. Le MFS U.S. Corporate Bond Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Zéro. Le MFS U.S. Corporate Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Zéro. Le MFS U.S. Corporate Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

S/O.

● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Concernant les titres de créance d'entreprises qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.

● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le MFS U.S. Corporate Bond Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

 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 de la taxinomie de l'UE.



Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements – MFS U.S. Corporate Bond Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 20 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : APA Group, Bank of America Corp, Becton Dickinson & Co, Diageo PLC, Duke Energy Corp, Edison International, Enel SpA, Glencore PLC, Plains All American Pipeline LP, ProLogis REIT, Sasol Ltd, Southern Co, Thermo Fisher Scientific Inc, Toronto-Dominion Bank, Volkswagen AG, Vulcan Materials Co et Westinghouse Air Brake Technologies Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque physique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l'analyse de scénarios climatiques.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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

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 dans lesquelles le produit financier investit 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

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Growth Fund (« **MFS U.S. Growth Fund** »)
Identifiant d'entité juridique : 549300DUBLFTWOTUSY90

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



Depuis le 31 décembre 2021, le MFS U.S. Growth Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Growth Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 85,29 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Growth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 84,45 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,02 % de l'actif du MFS U.S. Growth Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité

mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	65,03	64,39
31 janvier 2023	63,55	62,25
30 novembre 2021	53,80	52,84

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	66,34	65,69
31 janvier 2023	70,68	69,24
30 novembre 2021	62,0	60,94

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	85,29	84,45
31 janvier 2023	84,52	82,80
30 novembre 2021	78,42	77,03



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veuillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS U.S. Growth Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Growth Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Microsoft Corp	Technologies de l'information	9,67	États-Unis
Amazon.com Inc	Biens de consommation discrétionnaire	6,24	États-Unis
Alphabet Inc., Catégorie A	Services de communication	6,07	États-Unis
Apple Inc	Technologies de l'information	6,04	États-Unis
NVIDIA Corp	Technologies de l'information	5,47	États-Unis
Mastercard Inc	Finance	4,07	États-Unis
Visa Inc	Finance	3,40	États-Unis
Meta Platforms Inc	Services de communication	3,09	États-Unis
Boston Scientific Corp	Soins de santé	2,03	États-Unis
Vulcan Materials Co	Matériaux	1,86	États-Unis
MSCI Inc	Finance	1,80	États-Unis
Verisk Analytics Inc	Industrie	1,80	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 12 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

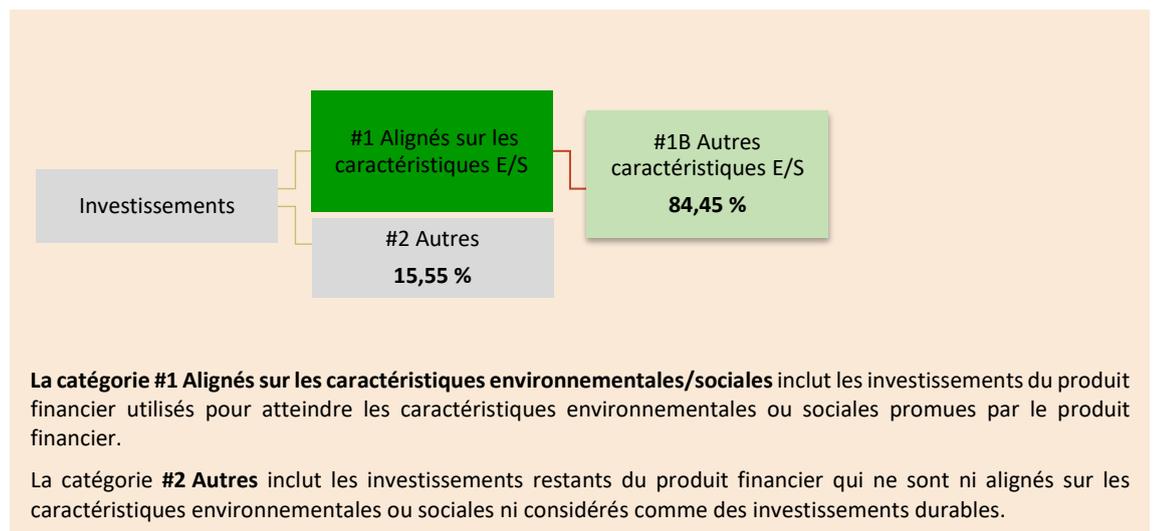
Le MFS U.S. Growth Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Growth Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs

décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 99,02 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Growth Fund ; les investissements restants (0,98 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 85,29 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Growth Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 84,45 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 15,55 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Technologies de l'information	36,77
Services de communication	12,26
Soins de santé	12,05
Biens de consommation discrétionnaire	10,41
Finance	9,81
Industrie	8,45
Matériaux	5,56
Biens de consommation courante	1,36
Immobilier	1,06
Liquidités et instruments assimilés	1,00
Énergie	0,68

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

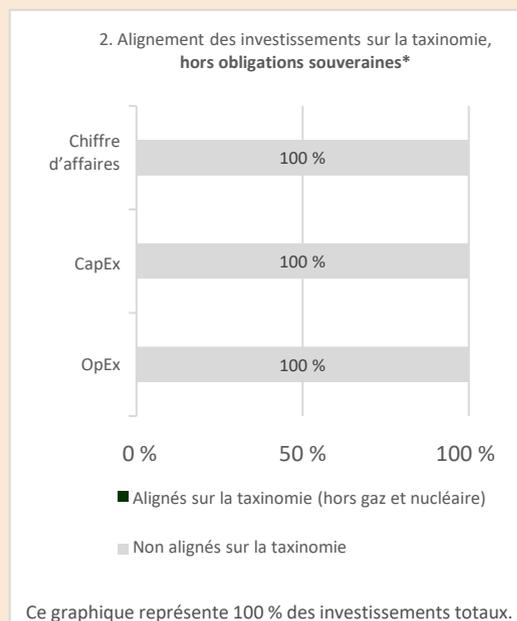
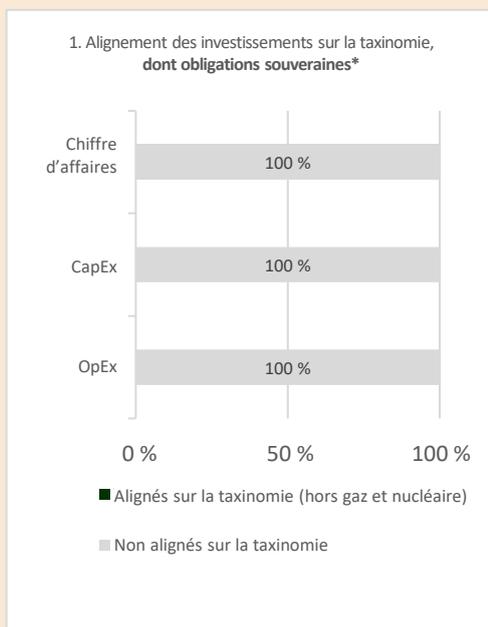
Zéro. Le MFS U.S. Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire
- Non. Le MFS U.S. Growth Fund ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.S. Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

 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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Growth Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



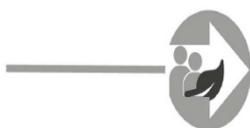
Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.S. Growth Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».

- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l’objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l’équipe d’investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d’autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d’exemple, les membres de l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l’équipe d’investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d’engagement auprès de plusieurs sociétés, et l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d’étape au titre de l’initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d’informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d’évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l’informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l’équipe d’investissement de MFS d’améliorer le recueil et l’évaluation des données ESG. En 2023, l’équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l’équipe d’investissement de MFS d’évaluer la performance climatique d’une entreprise ou d’un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d’informations essentielles à l’évaluation de l’alignement sur l’objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l’équipe d’investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l’ensemble de l’équipe d’investissement sur différents aspects de la recherche et de l’analyse liées au climat. À titre d’exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l’alignement sur l’initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l’équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l’approvisionnement en hydrogène. En outre, l’équipe d’investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS U.S. Growth Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l’investissement de MFS ont mené au moins 3 initiatives d’engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Thermo Fisher Scientific Inc. et Vulcan Materials Co. Parmi les sujets abordés, citons l’identification du risque lié au changement climatique. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Canadian Pacific Kansas City Limited. Les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d’actionnaires liées au climat de l’émetteur suivant au cours de la période sous revue : Martin Marietta Materials, Inc, Amazon.com, Inc et Alphabet Inc. Les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d’actionnaires liées au climat de l’émetteur suivant au cours de la période sous revue : Amazon.com, Inc, CoStar Group, Inc, Caterpillar Inc, Microsoft Corporation et Intuit Inc.



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.

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Total Return Bond Fund (« MFS U.S. Total Return Bond Fund »)

Identifiant d'entité juridique : YJVUBFW5FW4FOTQBP86

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

No

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/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?



Depuis le 21 juillet 2022, le MFS U.S. Total Return Bond Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Total Return Bond Fund visera à investir au moins 50 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1^{er} janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2023, 82,02 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS U.S. Total Return Bond Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 30,08 % de l'actif total. Les titres de créance d'entreprises représentaient 36,68 % de l'actif du MFS U.S. Total Return Bond Fund au 31 janvier 2023. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité

mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de créance d'entreprises : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	75,58	27,72
31 janvier 2023	66,58	28,59
30 juin 2022	70,64	26,86

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	23,92	8,77
31 janvier 2023	19,96	8,57
30 juin 2022	19,87	7,56

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 juin 2022	0	0

Critère climatique 4 – Mesure des activités qui facilitent la transition vers une économie à faible émission de carbone : pourcentage (%) des titres de créance d'entreprises du portefeuille investis dans des émetteurs qui se sont engagés à utiliser les fonds ainsi obtenus pour financer des activités d'adaptation et/ou d'atténuation du changement climatique ou pour atteindre une réduction des émissions de GES, tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 4	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	1,44	0,53
31 janvier 2023	1,07	0,46
30 juin 2022	1,59	0,60

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de créance d'entreprises du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2, 3 et/ou 4), selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de créance d'entreprises du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	82,02	30,08
31 janvier 2023	73,20	31,42
30 juin 2022	75,54	28,72

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

S/O.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS U.S. Total Return Bond Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions

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.

d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Total Return Bond Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance**. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
Bon du Trésor américain, 3,875 %, 31 mars 25	Bons du Trésor	5,35	États-Unis
Bon du Trésor américain, 4 %, 15 novembre 42	Bons du Trésor	3,08	États-Unis
Bon du Trésor américain, 3,875 %, 31 décembre 27	Bons du Trésor	2,44	États-Unis
Bon du Trésor américain, 1,625 %, 15 novembre 50	Bons du Trésor	2,11	États-Unis
Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 29 décembre 23	Bons du Trésor	2,09	États-Unis
Bon du Trésor américain, 4,25 %, 31 décembre 24	Bons du Trésor	1,99	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Contrat à terme standardisé à 2 ans sur obligation du Trésor américain, 28 mars 24	Bons du Trésor	1,63	États-Unis
Bon du Trésor américain, 5 %, 31 août 25	Bons du Trésor	1,05	États-Unis
Bon du Trésor américain, 4,125 %, 31 juillet 28	Bons du Trésor	0,86	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 21 juin 23	Bons du Trésor	0,75	États-Unis
Bon du Trésor américain, 2,25 %, 15 février 52	Bons du Trésor	0,73	États-Unis
Bon du Trésor américain, 4,625 %, 28 février 25	Bons du Trésor	0,69	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 19 mars 24	Bons du Trésor	0,69	États-Unis
T-Mobile USA Inc., 2,55 %, 15 février 31	Entreprise	0,67	États-Unis
Contrat à terme standardisé sur obligation du Trésor américain Ultra, 20 septembre 23	Bons du Trésor	0,66	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

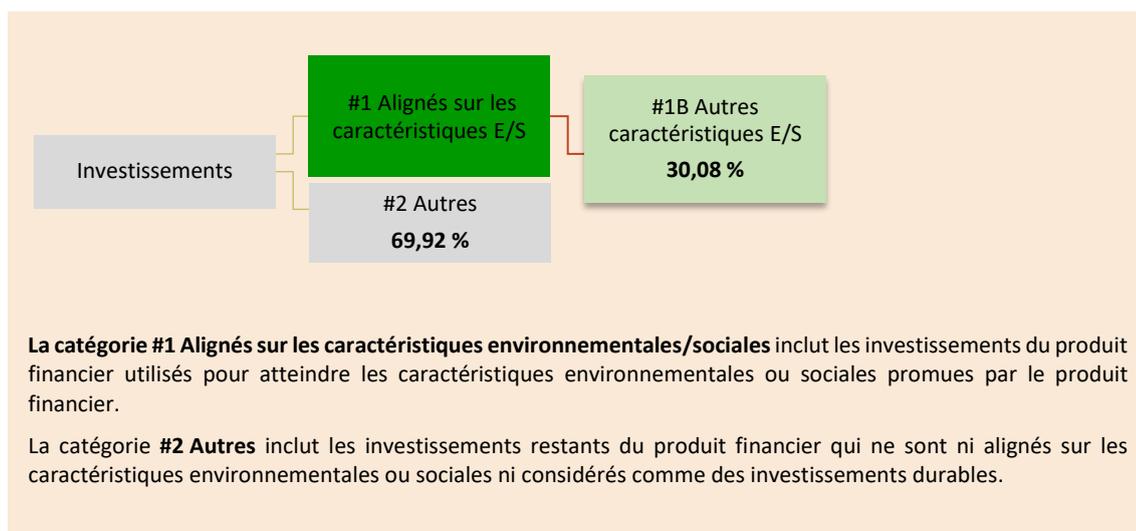
Le MFS U.S. Total Return Bond Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Total Return Bond Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

● Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2023, les titres de créance d'entreprises représentaient 36,68 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Total Return Bond Fund ; les investissements restants (63,32 % du portefeuille) comprenaient des titres de créance non émis par des sociétés, des produits dérivés, des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 82,02 % des titres de créance d'entreprises du portefeuille du MFS U.S. Total Return Bond répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 30,08 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 69,92 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable.

L'allocation des actifs

décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.



● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires avec flux identiques	24,99
Sociétés privées – industrie	24,05
Trésor – bons du Trésor	20,89
Sociétés privées – établissements financiers	13,92
Titrisation – obligations de prêts garantis	6,71
Produits dérivés – négociés en bourse	6,69
Titrisation – titres adossés à des créances hypothécaires commerciales	4,10
Sociétés privées – services publics	1,98
Titrisation – titres adossés à des actifs	0,84
Titrisation – obligation hypothécaire garantie	0,63
Obligations municipales – obligations locales	0,52
Gouvernement – autorités locales liées à un gouvernement	0,49
Liquidités – Liquidités	0,43
Obligations municipales – autres	0,22
Obligations municipales – éducation	0,18
Obligations municipales – santé	0,16
Gouvernement – agences gouvernementales	0,12

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.

Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués reposent sur les classifications du Bloomberg Global Sector Classification Scheme (« BCLASS ») et de MFS. Bloomberg Finance L.P., ses sociétés affiliées et ses concédants de licence détiennent tous les droits de propriété de BCLASS, lesquels ont été concédés

sous licence d'utilisation à MFS. MFS peut appliquer sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Total Return Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

Oui :

Dans le gaz fossile

Dans l'énergie nucléaire



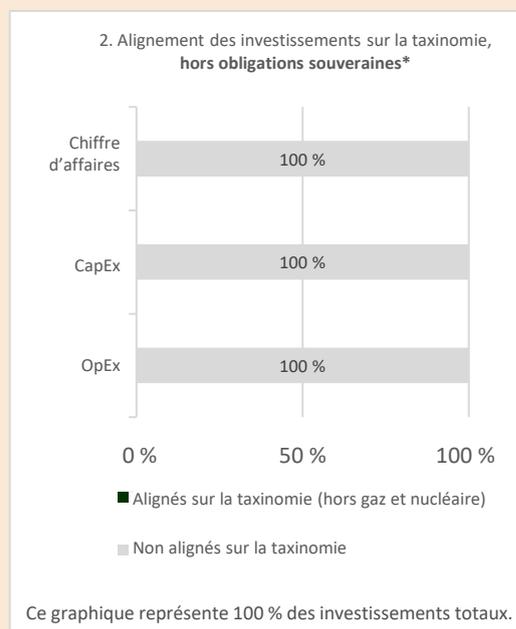
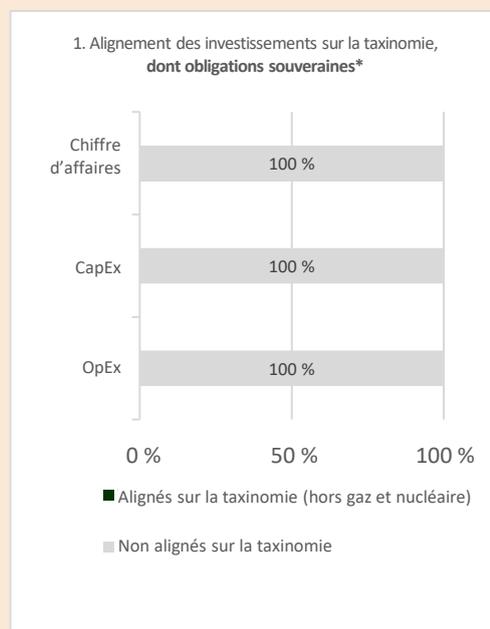
Non. Le MFS U.S. Total Return Bond Fund n'investit pas dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



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 de la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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 proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.S. Total Return Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

- **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 juin 2022	0 %	0 %	0 %



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Total Return Bond Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de titres de créance non émis par des entreprises, de produits dérivés, de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.S. Total Return Bond Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l'objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l'équipe d'investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d'autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d'exemple, les membres de l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l'équipe d'investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d'engagement auprès de plusieurs sociétés, et l'équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d'étape au titre de l'initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d'informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d'évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l'informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l'équipe d'investissement de MFS d'améliorer le recueil et l'évaluation des données ESG. En 2023, l'équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l'équipe d'investissement de MFS d'évaluer la performance climatique d'une entreprise ou d'un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d'informations essentielles à l'évaluation de l'alignement sur l'objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l'équipe d'investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l'ensemble de l'équipe d'investissement sur différents aspects de la recherche et de l'analyse liées au climat. À titre d'exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l'alignement sur l'initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l'équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l'approvisionnement en hydrogène. En outre, l'équipe d'investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements - MFS U.S. Total Return Bond Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l'investissement de MFS ont mené au moins 9 initiatives d'engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : Bank of America Corp, Enel SpA, Glencore PLC, Plains All American Pipeline LP, Vulcan Materials Co et Westinghouse Air Brake Technologies Corp. Parmi les sujets abordés, citons l'identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition et les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi).

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>



Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

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 dans lesquelles le produit financier investit 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.

Dénomination du produit : MFS Meridian Funds – U.S. Value Fund (« MFS U.S. Value Fund »)
Identifiant d'entité juridique : GB105HOU4PVHR7NT1015

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-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** : _____ %

No

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de _____ % d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés 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 et réalisés 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 d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

À compter du 31 décembre 2021, le MFS U.S. Value Fund a favorisé la caractéristique MFS Low Carbon Transition, qui porte sur la transition vers une économie sobre en carbone que MFS promeut dans le cadre de ses allocations de capital par le biais d'un engagement actif et de l'application de critères climatiques à certains investissements réalisés par ce produit. En particulier, le MFS U.S. Value Fund visera à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondront, à compter du 1er janvier 2027 (la « Date de transition »), à au moins un des trois critères climatiques (voir ci-après).

Au 31 janvier 2024, 89,07 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, ce qui représentait 88,80 % de l'actif total. Les titres de participation représentaient 99,69 % de l'actif du MFS U.S. Value Fund au 31 janvier 2024. Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.

Les indicateurs de durabilité

mesurent la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Ces informations périodiques concernent la période allant du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Critère climatique 1 – Mesure de l'intensité de GES des émetteurs de titres de participation : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont réduit l'intensité annuelle de leurs émissions de GES, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 1	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	82,98	82,72
31 janvier 2023	72,73	72,02
30 novembre 2021	83,44	82,39

Critère climatique 2 – Mesure d'un programme reconnu de réduction ou de stabilisation des émissions de GES : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs qui ont adopté de tels programmes, selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 2	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	51,04	50,88
31 janvier 2023	48,95	48,47
30 novembre 2021	37,20	36,74

Critère climatique 3 – Mesure des émetteurs « zéro émission nette » : pourcentage (%) des titres de participation du portefeuille investis dans des émetteurs dont les activités ont un bilan « zéro émission nette », déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critère climatique 3	% de titres de participation du portefeuille répondant à ce critère	% de l'actif total du portefeuille répondant à ce critère
31 janvier 2024	0	0
31 janvier 2023	0	0
30 novembre 2021	0	0

Conformité aux critères climatiques – mesure du pourcentage (%) de titres de participation du portefeuille qui respectaient au moins l'un des Critères climatiques (1, 2 et/ou 3) tel que déterminé selon la méthodologie présentée dans les informations fournies en ligne (voir lien ci-après).

Critères climatiques	% de titres de participation du portefeuille répondant à l'un des critères	% de l'actif total du portefeuille répondant à l'un des critères
31 janvier 2024	89,07	88,80
31 janvier 2023	85,03	84,46
30 novembre 2021	92,34	91,17



● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Veillez vous reporter aux informations figurant à la section « *Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?* » ci-dessus.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet.

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. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

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'Union européenne 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'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Le MFS U.S. Value Fund ne prend pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au sens du Règlement européen sur la taxinomie. En conséquence, le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » ne s'applique à aucun des investissements de ce produit financier.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

MFS estime que l'intégration de facteurs de durabilité (environnementaux, sociaux et de gouvernance, ou ESG) importants d'un point de vue financier dans les processus d'analyse des investissements et de prise de décision conduit à une prise de décision plus éclairée qui permettra d'obtenir des rendements à long terme. Les professionnels de l'investissement de MFS, au sein de la plate-forme d'étude internationale de MFS, ont accès à des tableaux de bord interactifs exclusifs qui leur permettent de visualiser et d'analyser divers éléments de données ESG, notamment les indicateurs des principales incidences négatives présentés ci-dessous. Ces éléments de données ESG devraient permettre aux professionnels de l'investissement de MFS de mieux comprendre et évaluer l'impact financier des facteurs de durabilité (ESG) sur les émetteurs et le portefeuille, ainsi que l'impact externe négatif des émetteurs et du portefeuille sur les facteurs de durabilité (ESG), et de prendre des décisions d'investissement éclairées à long terme conformes à l'objectif d'investissement financier du MFS U.S. Value Fund.

Pour favoriser davantage la caractéristique MFS Low Carbon Transition qui intègre les indicateurs des principales incidences négatives que sont les **émissions de GES** (Scope 1 et 2 et, le cas échéant, 3) et **l'intensité de GES des sociétés dans lesquelles le produit a investi**, MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs supplémentaires des principales incidences négatives en matière d'émissions de gaz à effet de serre suivants : **empreinte carbone, exposition aux sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles, part de consommation et de production d'énergie non renouvelable et intensité de consommation d'énergie par secteur à fort impact climatique** (ensemble, les « **Indicateurs d'émissions supplémentaires** »). Au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS prennent en considération ces Indicateurs d'émissions supplémentaires, ainsi que la caractéristique MFS Low Carbon Transition et les critères climatiques sous-jacents depuis juillet 2022. Les professionnels de l'investissement de MFS utiliseront les Indicateurs d'émissions supplémentaires dans le cadre de leur évaluation globale afin de déterminer si les émetteurs sont prêts à faire évoluer leurs activités vers une économie à faible émission de carbone, et poursuivront leur engagement auprès des émetteurs conformément à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. MFS met également à la disposition des professionnels de l'investissement les indicateurs des principales incidences négatives sociales suivants : **violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises**

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.

multinationales et mixité au sein des organes de gouvernance. Le cadre d'intégration ESG plus global des professionnels de l'investissement de MFS tiendra compte de ces indicateurs dans le processus d'investissement afin d'évaluer l'importance financière et leurs pratiques d'engagement. En partenariat avec son équipe mondiale de gestion responsable et son équipe de spécialistes ESG, MFS évalue et traite les éventuelles incidences négatives des entreprises étudiées au niveau du portefeuille par le biais de son approche d'engagement pouvant inclure (selon le cas) un engagement direct, un vote par procuration et des collaborations sectorielles.

Les problèmes de développement durable sont complexes, interconnectés et évolutifs. MFS estime que l'importance relative des principales incidences négatives ne peut faire l'objet d'un processus automatisé. La prise en compte, par les professionnels de l'investissement de MFS, de l'importance relative d'un point de vue financier des principales incidences négatives est généralement subjective et implique souvent d'envisager des risques ou possibilités intangibles et difficiles à mesurer. Leur analyse sera donc approfondie, qualitative, spécifique à l'émetteur et contextuelle. Les professionnels de l'investissement de MFS sauront faire preuve de la souplesse nécessaire pour intégrer les principales incidences négatives à chaque étape du processus d'investissement et des activités d'engagement. En outre, la mesure dans laquelle ils tiennent compte des principales incidences négatives peut varier. Il est important de noter que les professionnels de l'investissement de MFS n'utilisent pas les indicateurs des principales incidences négatives comme base d'exclusions ou de filtres, ni dans un cadre d'optimisation purement quantitative du portefeuille. Étant donné que les principales incidences négatives sont intégrées au niveau du portefeuille, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement auprès de certains émetteurs du portefeuille concernant les questions considérées comme financièrement importantes et ne poursuivront pas leur engagement auprès de chaque émetteur du portefeuille.



La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion des investissements du produit financier au cours de la période de référence, qui va du 1er février 2023 au 31 janvier 2024.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Investissements les plus importants	Secteur	% de l'actif	Pays
JPMorgan Chase & Co	Finance	4,10	États-Unis
Cigna Group	Soins de santé	2,73	États-Unis
Johnson & Johnson	Soins de santé	2,58	États-Unis
ConocoPhillips	Énergie	2,57	États-Unis
Progressive Corp	Finance	2,56	États-Unis
Comcast Corp	Services de communication	2,56	États-Unis
Aon PLC	Finance	2,51	États-Unis
Marsh & McLennan Cos Inc	Finance	2,50	États-Unis
Northrop Grumman Corp	Industrie	2,30	États-Unis
Lowe's Cos Inc	Biens de consommation discrétionnaire	2,13	États-Unis
Texas Instruments Inc	Technologies de l'information	2,04	États-Unis
Accenture PLC	Technologies de l'information	2,03	États-Unis
Union Pacific Corp	Industrie	1,99	États-Unis
Chubb Ltd	Finance	1,98	États-Unis
McKesson Corp	Soins de santé	1,95	États-Unis

Les principales participations ci-dessus représentent la pondération moyenne des 15 premiers titres en portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

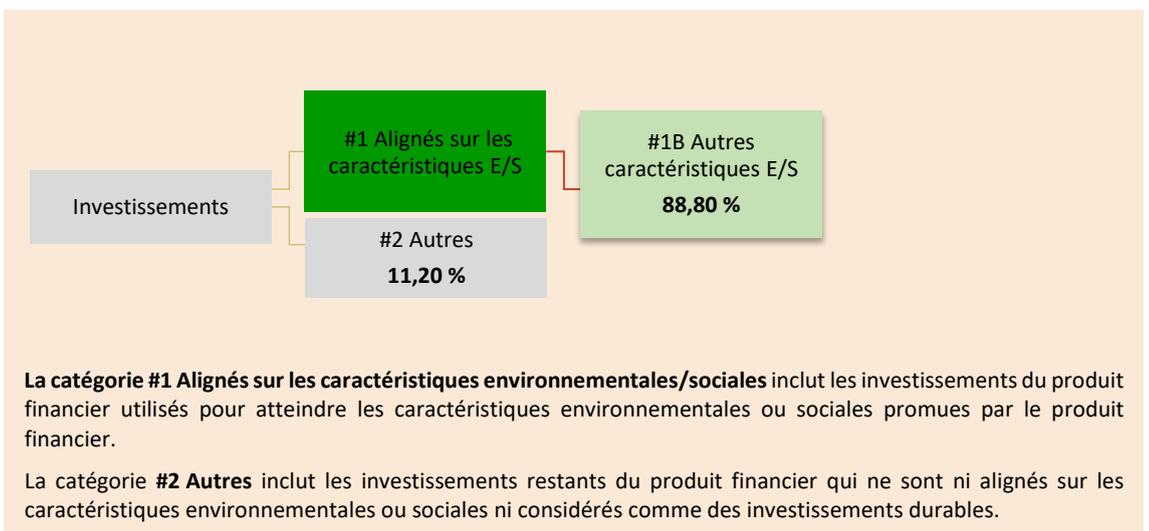
Le MFS U.S. Value Fund vise à investir au moins 50 % des titres de participation du portefeuille dans des émetteurs qui répondent à au moins un des critères climatiques à compter de la Date de transition et sont donc alignés sur les caractéristiques E/S promues par le MFS U.S. Value Fund (catégorie #1) à compter de la Date de transition. Veuillez consulter la section consacrée à l'allocation des actifs ci-dessous pour connaître la proportion d'investissements liés à la durabilité.

L'allocation des actifs

décrit la proportion d'investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 janvier 2024, les titres de participation représentaient 99,69 % de l'actif total du portefeuille du MFS U.S. Value Fund ; les investissements restants (0,31 % du portefeuille) comprenaient des liquidités et/ou des instruments assimilés ; 89,07 % des titres de participation du portefeuille du MFS U.S. Value Fund répondaient à au moins un des critères climatiques, c.-à-d. que 88,80 % de l'actif total du portefeuille réalisait la caractéristique MFS Low Carbon Transition (ce qui n'était pas suffisant pour que ces actifs soient considérés comme des investissements durables) ; 11,20 % de l'actif total n'était pas aligné sur la caractéristique MFS Low Carbon Transition ou considéré comme de l'investissement durable (#2 Autres). Veuillez noter que les pourcentages de l'actif total peuvent différer de ceux indiqués dans les états financiers inclus dans le Rapport annuel des actionnaires en raison de certains ajustements qui ont été apportés à des fins de reporting.



Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteurs	Pondération moyenne en %
Finance	24,89
Soins de santé	16,52
Industrie	16,18
Technologies de l'information	8,25
Services publics	7,49
Biens de consommation courante	7,21
Énergie	5,21
Biens de consommation discrétionnaire	3,85
Matériaux	3,79
Services de communication	3,54
Immobilier	2,06
Liquidités et instruments assimilés	0,89
Autre	0,01

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en % :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la proportion des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit ;
- des **dépenses d'investissement** (« CapEx ») pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier investit, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (« OpEx ») pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier investit.



Les participations sectorielles ci-dessus représentent la pondération sectorielle moyenne du portefeuille à la fin des trimestres clôturés les 31 mars 2023, 30 juin 2023, 30 septembre 2023 et 31 décembre 2023. Les pondérations se fondent sur les expositions équivalentes, qui mesurent la modification de la valeur d'un portefeuille résultant des fluctuations de cours des actifs détenus directement ou, dans le cas d'un contrat sur produits dérivés, indirectement. On peut observer des différences au niveau de la valeur de marché des participations. Les secteurs indiqués se fondent sur les secteurs de la norme internationale de classification sectorielle Global Industry Classification Standard (GICS®) et les classifications de MFS. La norme GICS a été développée par et/ou est la propriété exclusive de MSCI, Inc. et S&P Global Market Intelligence Inc. (« S&P Global Market Intelligence »). La norme GICS est une marque de service de MSCI et S&P Global Market Intelligence. Elle a été concédée sous licence d'utilisation à MFS. MFS a appliqué sa propre méthodologie de classification sectorielle interne pour les titres de participation et autres titres qui n'apparaissent pas dans la classification GICS.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

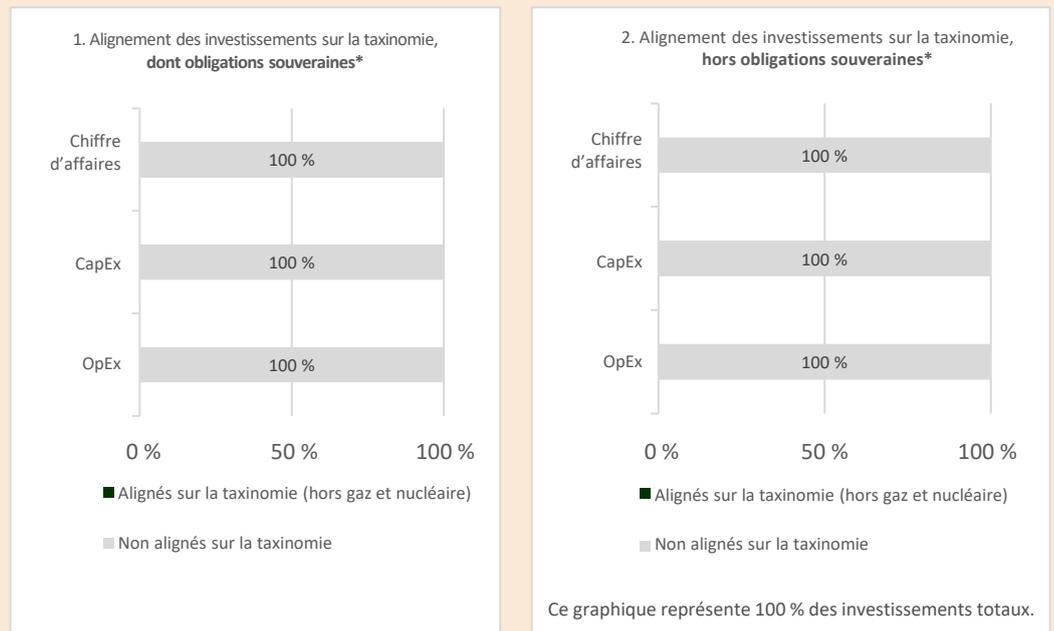
Zéro. Le MFS U.S. Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?

- Oui :
 - Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non. Le MFS U.S. Value Fund ne surveille pas la conformité des investissements à la taxinomie de l'UE.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient 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.

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'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Zéro. Le MFS U.S. Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des activités transitoires ou habilitantes telles que définies en vertu de la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.

Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?

Alignement des investissements sur la taxinomie	Chiffre d'affaires	CapEx	OpEx
31 janvier 2023	0 %	0 %	0 %
30 novembre 2021	0 %	0 %	0 %

 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 de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Zéro. Le MFS U.S. Value Fund n'a pas pour objectif d'investir dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE et ne s'engage pas à le faire.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

S/O.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Concernant les titres de participation qui ne respectent pas les critères climatiques de la caractéristique MFS Low Carbon Transition, les professionnels de l'investissement de MFS poursuivront leur engagement actif auprès de leurs émetteurs concernant les critères climatiques. Le reste du portefeuille détenait des instruments qui ne sont pas soumis à la caractéristique MFS Low Carbon Transition. Il peut s'agir de liquidités et d'instruments assimilés.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Le MFS U.S. Value Fund est géré par des professionnels de l'investissement de MFS opérant au sein de la plate-forme intégrée de recherche internationale de MFS. En plus de soutenir l'analyse des investissements et la prise de décision au niveau stratégique, certaines initiatives sont entreprises au niveau de la plate-forme pour tous les portefeuilles de MFS (« Initiatives de la plate-forme »). Vous trouverez ci-dessous des informations sur les Initiatives de la plate-forme qui prennent en charge la caractéristique MFS Low Carbon Transition.

Initiatives de la plate-forme

Net Zero Asset Managers (« NZAM »)

En 2021, MFS a rejoint l'initiative NZAM. En tant que signataire, MFS est tenu de s'engager à ce qu'une partie des actifs sous gestion soit alignée sur les principes « zéro émission nette ». En mai 2022, MFS a publié des objectifs intermédiaires et à long terme pour s'aligner sur l'initiative NZAM.

Objectifs intermédiaires et à long terme de MFS :

- 2030 – 90 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés ou en voie d'alignement sur l'objectif de « zéro émission nette ».
- 2040 – 100 % des actifs sous gestion concernés seront considérés comme étant alignés sur l'objectif de « zéro émission nette ».

- 2050 – 100 % des actifs sous gestion seront considérés comme « atteignant l’objectif de zéro émission nette ».

Au cours des douze derniers mois, l’équipe d’investissement de MFS a commencé à définir des cadres généraux et d’autres spécifiques à certains secteurs pour évaluer les progrès accomplis par les sociétés dans leur alignement sur les objectifs à long terme « zéro émission nette ». À titre d’exemple, les membres de l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS ont travaillé en étroite collaboration avec l’équipe d’investissement durable de MFS pour évaluer certaines sociétés à fort impact. Nous avons conduit des actions d’engagement auprès de plusieurs sociétés, et l’équipe sectorielle « consommation de base » de MFS a organisé une réunion pour présenter ses conclusions au groupe élargi des analystes et gestionnaires de portefeuille de MFS.

MFS a également élaboré son premier Rapport d’étape au titre de l’initiative Net Zero Asset Managers (« NZAM »), disponible sur www.mfs.com.

Groupe de travail sur la publication d’informations financières relatives au climat (Task Force on Climate related Financial Disclosures, « TCFD »)

Le deuxième Rapport annuel TCFD de MFS inclut des données et des informations supplémentaires sur notre approche d’évaluation et de gestion du risque climatique. Ce rapport présente de plus amples informations sur les points de vue de MFS concernant les scénarios climatiques et les limitations propres à leur analyse, tout en détaillant nos nouveaux engagements et nos efforts déployés en faveur du climat. La version intégrale du Rapport TCFD 2023 de MFS est disponible sur www.mfs.com.

Améliorations technologiques de MFS relatives au climat

MFS emploie des professionnels de l’informatique qui se consacrent à intégrer les données ESG dans les systèmes de MFS et à concevoir de nouveaux outils et visualisations qui permettent à l’équipe d’investissement de MFS d’améliorer le recueil et l’évaluation des données ESG. En 2023, l’équipe informatique de MFS a mis au point de nouveaux outils en utilisant un logiciel de visualisation qui permet à l’équipe d’investissement de MFS d’évaluer la performance climatique d’une entreprise ou d’un portefeuille. En outre, nous avons mis en place un nouvel outil front-end qui permettra la collecte d’informations essentielles à l’évaluation de l’alignement sur l’objectif « zéro émission nette ».

Recherche et analyse continues

Les membres de l’équipe d’investissement de MFS spécialisés dans la durabilité ont continué à travailler avec l’ensemble de l’équipe d’investissement sur différents aspects de la recherche et de l’analyse liées au climat. À titre d’exemple, dans le cadre des réexamens annuels de la durabilité, des données détaillées concernant les engagements climatiques et l’alignement sur l’initiative NZAM ont été partagés avec les équipes de gestion de portefeuille, et l’équipe a mené des recherches englobant différents enjeux tels que la préservation du capital naturel, le captage du carbone et l’approvisionnement en hydrogène. En outre, l’équipe d’investissement de MFS a élaboré et partagé des présentations sur des sujets tels que les risques propres aux entreprises exploitant des sables bitumineux au regard de la transition énergétique et climatique.

Engagements et vote par procuration - MFS U.S. Value Fund

Au cours de la période sous revue, les professionnels de l’investissement de MFS ont mené au moins 9 initiatives d’engagement auprès des émetteurs du portefeuille du Fonds sur les risques et opportunités liés au climat, notamment : ConocoPhillips, Diageo PLC, Duke Energy Corp, EOG Resources Inc, Lowe’s Cos Inc, PPG Industries Inc, ProLogis REIT et Southern Co. Parmi les sujets abordés, citons l’identification du risque lié au changement climatique, le risque de transition, les initiatives « zéro émission nette » / Science Based Targets (SBTi) et l’analyse de scénarios climatiques. Au cours de la période sous revue, les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions de la direction sur les plans de transition climatique des émetteurs suivants : Canadian National Railway Company. Les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté POUR les propositions d’actionnaires liées au climat de l’émetteur suivant au cours de la période sous revue : PACCAR Inc, Public Storage, Raytheon Technologies Corporation et Honeywell International Inc. Les professionnels de l’investissement de MFS ont également évalué et voté CONTRE les propositions d’actionnaires liées au climat de l’émetteur suivant au cours de la période sous revue : Citigroup Inc, The

Goldman Sachs Group, Inc, PepsiCo, Inc, JPMorgan Chase & Co, Chubb Limited, Morgan Stanley, BlackRock, Inc, The Southern Company The Travelers Companies, Inc et Comcast Corporation.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

S/O.

Lien pour accéder aux informations publiées en ligne :

<https://www.mfs.com/content/mfs-enterprise/microsites/meridian/global/en/mfs-meridian-funds.html>

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.